

嘉实中证 500 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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.....	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.....	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.....	11
§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）	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	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 期末投资目标基金明细.....	49
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.13 投资组合报告附注.....	50

§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 备查文件目录	54
11.1 备查文件目录.....	54
11.2 存放地点.....	54
11.3 查阅方式.....	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	嘉实中证 500ETF 联接
基金主代码	000008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 3 月 22 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	65,059,478.95 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	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 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	中国建设银行股份有限公司

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，本基金相对于业绩比较基准的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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95% + 银行活期存款税后利率*5%。
风险收益特征	本基金为嘉实中证 500ETF 的联接基金，主要通过投资于嘉实中证 500ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 500 指数及嘉实中证 500ETF 的表现密切相关。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	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
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	中证 500 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	田青
	联系电话	(010) 65215588	(010) 67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	(010) 67595096
传真		(010) 65182266	(010) 66275853
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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100005	100033
法定代表人		安奎	王洪章

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	1,094,881.75
本期利润	1,836,925.04
加权平均基金份额本期利润	0.0297
本期加权平均净值利润率	2.69%
本期基金份额净值增长率	2.13%
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	7,654,598.46
期末可供分配基金份额利润	0.1177
期末基金资产净值	72,714,077.41
期末基金份额净值	1.1177
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	11.77%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。(2) 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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	2.62%	0.92%	2.38%	0.93%	0.24%	-0.01%
过去三个月	2.33%	1.00%	2.11%	1.01%	0.22%	-0.01%
过去六个月	2.13%	1.18%	2.43%	1.19%	-0.30%	-0.01%
过去一年	18.74%	1.24%	20.27%	1.26%	-1.53%	-0.02%
自基金合同生效起至今	11.77%	1.24%	9.74%	1.30%	2.03%	-0.06%

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

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

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

Benchmark(0)=1000

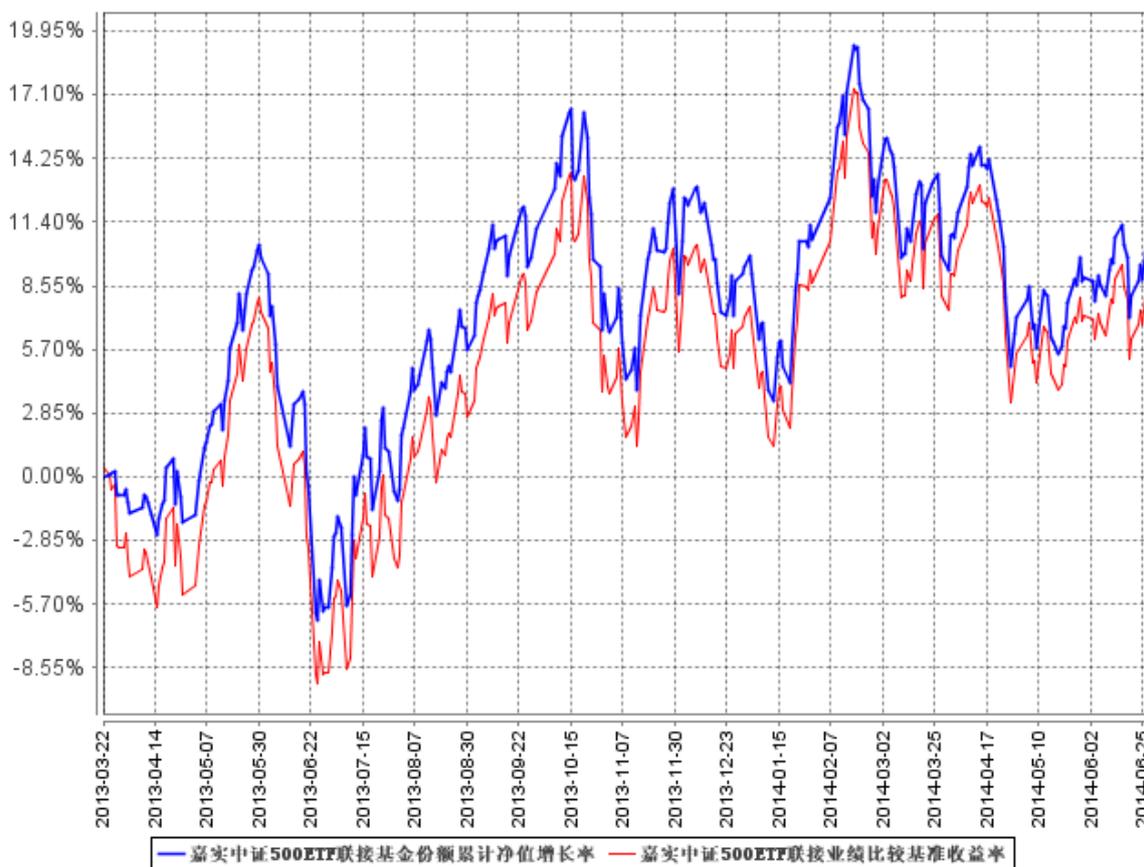
Return(t)=95%×中证 500 指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中 t=1, 2, 3, …。

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

嘉实中证500ETF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：嘉实中证 500ETF 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
(2013 年 3 月 22 日至 2014 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“第十二部分（二）投资范围和（七）投资限制”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 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		

杨宇	本基金、嘉实沪深 300ETF、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实中证 500ETF、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	2013 年 3 月 22 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) 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、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和其他相关法律法规的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定, 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 0.02%，年度化拟合偏离度为 0.36%，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 的跟踪偏离。

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 1.1177 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.13%，业绩比较基准收益率为 2.43%。

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、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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：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	4,300,043.13	4,964,703.20
结算备付金		51,318.48	35,516.11
存出保证金		14,513.45	17,474.61
交易性金融资产	6.4.7.2	68,584,011.71	64,908,819.37
其中：股票投资		1,868,080.73	4,571.00
基金投资		66,715,930.98	64,904,248.37
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		1,394,500.67	4,137,602.64

应收利息	6.4.7.5	921.11	1,035.18
应收股利		-	-
应收申购款		173,829.11	556,016.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	7,527.76
资产总计		74,519,137.66	74,628,695.66
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		-	-
应付赎回款		1,603,910.47	5,834,186.00
应付管理人报酬		2,589.40	2,611.11
应付托管费		517.87	522.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	13,298.10	22,029.71
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	184,744.41	308,047.66
负债合计		1,805,060.25	6,167,396.70
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	65,059,478.95	62,555,323.84
未分配利润	6.4.7.10	7,654,598.46	5,905,975.12
所有者权益合计		72,714,077.41	68,461,298.96
负债和所有者权益总计		74,519,137.66	74,628,695.66

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1177 元，基金份额总额 65,059,478.95 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：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3月22日(基 金合同生效日)至 2013年6月30日
一、收入		2,108,848.28	5,966,738.72
1.利息收入		16,671.54	139,811.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,671.54	139,811.84

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		1,272,886.95	11,639,437.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-146,957.77	1,745,209.28
基金投资收益	6.4.7.13	1,406,891.14	9,739,151.24
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	12,953.58	155,076.92
3.公允价值变动收益	6.4.7.17	742,043.29	-6,121,373.21
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.18	77,246.50	308,862.65
减：二、费用		271,923.24	839,919.24
1. 管理人报酬		14,468.65	136,083.45
2. 托管费		2,893.69	27,216.69
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	63,781.75	630,047.65
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	190,779.15	46,571.45
三、利润总额		1,836,925.04	5,126,819.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润		1,836,925.04	5,126,819.48

注：本基金基金合同生效日为 2013 年 3 月 22 日，上年度可比期间为 2013 年 3 月 22 日至 2013 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证 500 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）	62,555,323.84	5,905,975.12	68,461,298.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	1,836,925.04	1,836,925.04

润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,504,155.11	-88,301.70	2,415,853.41
其中：1. 基金申购款	58,284,419.53	6,609,331.68	64,893,751.21
2. 基金赎回款	-55,780,264.42	-6,697,633.38	-62,477,897.80
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）	65,059,478.95	7,654,598.46	72,714,077.41
项目	上年度可比期间 2013 年 3 月 22 日（基金合同生效日）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）	292,915,388.83	-	292,915,388.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,126,819.48	5,126,819.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-197,531,869.73	-10,723,887.58	-208,255,757.31
其中：1. 基金申购款	36,945,475.70	1,875,947.56	38,821,423.26
2. 基金赎回款	-234,477,345.43	-12,599,835.14	-247,077,180.57
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）	95,383,519.10	-5,597,068.10	89,786,451.00

注：本基金合同生效日为 2013 年 3 月 22 日，上年度可比期间是指 2013 年 3 月 22 日至 2013 年 6 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：

<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

嘉实中证 500 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]1588号《关于核准嘉实中证 500 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《嘉实中证 500 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 292,881,567.31 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(2013)第 154 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2013 年 3 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 292,915,388.83 份基金份额,其中认购资金利息折合 33,821.52 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金为嘉实中证 500 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证 500 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《嘉实中证 500 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%(已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内),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)、一级市场新股或增发的股票、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、中小企业私募债、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证 500 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》、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和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	4,300,043.13
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	4,300,043.13

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	1,815,444.32	1,868,080.73	52,636.41
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	61,993,913.09	66,715,930.98	4,722,017.89
其他	-	-	-
合计	63,809,357.41	68,584,011.71	4,774,654.30

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	877.25
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	29.08
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	8.18
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.60
合计	921.11

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（应收替代款、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	13,298.10
银行间市场应付交易费用	-
合计	13,298.10

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	6,225.92
预提费用	178,518.49
应付指数使用费	-
可退替代款	-
应付替代款	-
其他	-
合计	184,744.41

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	62,555,323.84	62,555,323.84
本期申购	58,284,419.53	58,284,419.53
本期赎回	-55,780,264.42	-55,780,264.42
本期末	65,059,478.95	65,059,478.95

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	7,369,453.25	-1,463,478.13	5,905,975.12
本期利润	1,094,881.75	742,043.29	1,836,925.04
本期基金份额交易产生的变动数	433,147.12	-521,448.82	-88,301.70
其中：基金申购款	7,663,289.38	-1,053,957.70	6,609,331.68
基金赎回款	-7,230,142.26	532,508.88	-6,697,633.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,897,482.12	-1,242,883.66	7,654,598.46

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	15,870.08
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	549.46
其他	252.00
合计	16,671.54

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	63,000.39
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-209,958.16
合计	-146,957.77

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	23,595,479.21
减：卖出股票成本总额	23,532,478.82
买卖股票差价收入	63,000.39

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	17,398,305.00
减：现金支付申购款总额	344,407.26
减：申购股票成本总额	17,263,855.90
申购差价收入	-209,958.16

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	17,686,270.22
减：卖出/赎回基金成本总额	16,279,379.08
基金投资收益	1,406,891.14

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	12,953.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,953.58

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	742,043.29
——股票投资	52,673.96
——债券投资	-
——基金投资	689,369.33
——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	742,043.29

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	52,101.80
基金转出费收入	25,144.70
债券认购手续费返还	-
替代损益	-
印花税手续费返还	-
其他	-
合计	77,246.50

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	63,781.75
银行间市场交易费用	-
合计	63,781.75

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	29,752.78
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	2,860.66
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
其他	400.00
合计	190,779.15

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（“嘉实中证 500ETF”）	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 3 月 22 日（基金合同生效日）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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 3 月 22 日（基金合同生效日） 至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,468.65	136,083.45
其中：支付销售机构的客户维护费	66,745.01	181,642.75

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 3 月 22 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,893.69	27,216.69

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建设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 3 月 22 日（基金合同生效日）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 3 月 22 日（基金合同生效日）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		上年度可比期间	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		2013 年 3 月 22 日(基金合同生效日)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
中国建设银行	4,300,043.13	15,870.08	4,782,055.02	134,589.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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 3 月 22 日（基金合同生效日）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 16,915,804.00 份目标 ETF 基金份额（2013 年 12 月 31 日：16,915,804.00 份），占其总份额的比例为 32.42%（2013 年 12 月 31 日：25.93%）。

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

本期末（2014 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
002551	尚荣医疗	2014 年 6 月 12 日	重大事项停牌	34.01	未知	未知	400	13,381.51	13,604.00	-
601012	隆基股份	2014 年 6 月 19 日	重大事项停牌	15.50	2014 年 7 月 1 日	15.60	600	8,517.00	9,300.00	-
002340	格林美	2014 年 6 月 26 日	重大事项停牌	11.19	2014 年 7 月 24 日	11.77	800	8,989.82	8,952.00	-
600418	江淮汽车	2014 年 4 月 14 日	重大事项停牌	10.20	2014 年 7 月 11 日	11.22	800	8,160.00	8,160.00	-
600260	凯乐科技	2014 年 6 月 9 日	重大事项停牌	6.59	未知	未知	1,100	7,468.65	7,249.00	-
600059	古越龙山	2014 年 6 月 30 日	重大事项停牌	7.97	2014 年 7 月 1 日	7.83	850	6,568.29	6,774.50	-
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	6,699.00	6,398.00	-
600582	天地科技	2014 年 6 月 26 日	重大事项停牌	7.97	未知	未知	800	6,583.00	6,376.00	-
600757	长江	2014 年	重大	8.85	未知	未知	600	5,191.15	5,310.00	-

	传媒	6月17日	事项停牌								
600490	鹏欣资源	2014年4月1日	重大事项停牌	6.11	2014年7月15日	6.11	800	4,888.00	4,888.00	-	
000852	江钻股份	2014年5月28日	重大事项停牌	15.80	未知	未知	300	4,621.31	4,740.00	-	
601777	力帆股份	2014年6月24日	重大事项停牌	6.39	2014年7月8日	6.70	700	4,642.99	4,473.00	-	
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	300	3,993.05	4,245.00	-	
000762	西藏矿业	2014年4月29日	重大事项停牌	10.54	2014年7月28日	11.59	400	4,216.00	4,216.00	-	
000612	焦作万方	2014年4月3日	重大事项停牌	6.08	2014年8月18日	6.69	600	3,648.00	3,648.00	-	
600685	广船国际	2014年4月8日	重大事项停牌	17.13	未知	未知	200	3,428.00	3,426.00	-	
600507	方大特钢	2014年6月30日	重大事项停牌	3.16	2014年7月2日	3.03	900	2,840.83	2,844.00	-	
600864	哈投股份	2014年4月11日	重大事项停牌	8.68	2014年7月15日	8.30	300	2,604.00	2,604.00	-	
600755	厦门国贸	2014年6月27日	配股申购期间停牌	4.85	2014年7月7日	4.74	500	2,523.57	2,425.00	-	
600850	华东电脑	2014年4月4日	重大事项停牌	19.56	2014年7月11日	21.52	100	1,956.00	1,956.00	-	

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工作流程、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建设银行，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	4,300,043.13	-	-	-	4,300,043.13
结算备付金	51,318.48	-	-	-	51,318.48
存出保证金	14,513.45	-	-	-	14,513.45
交易性金融资产	-	-	-	68,584,011.71	68,584,011.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,394,500.67	1,394,500.67
应收利息	-	-	-	921.11	921.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	3,900.00	-	-	169,929.11	173,829.11
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,369,775.06	-	-	70,149,362.60	74,519,137.66

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	-	-	-	1,603,910.47	1,603,910.47
应付管理人报酬	-	-	-	2,589.40	2,589.40
应付托管费	-	-	-	517.87	517.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	13,298.10	13,298.10
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	184,744.41	184,744.41
负债总计	-	-	-	1,805,060.25	1,805,060.25
利率敏感度缺口	4,369,775.06	-	-	68,344,302.35	72,714,077.41
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	4,964,703.20	-	-	-	4,964,703.20
结算备付金	35,516.11	-	-	-	35,516.11
存出保证金	17,474.61	-	-	-	17,474.61
交易性金融资产	-	-	-	64,908,819.37	64,908,819.37
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	4,137,602.64	4,137,602.64
应收利息	-	-	-	1,035.18	1,035.18
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	2,000.00	-	-	554,016.79	556,016.79
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	7,527.76	7,527.76
资产总计	5,019,693.92	-	-	69,609,001.74	74,628,695.66
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	-	-	-	5,834,186.00	5,834,186.00
应付管理人报酬	-	-	-	2,611.11	2,611.11
应付托管费	-	-	-	522.22	522.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	22,029.71	22,029.71
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	308,047.66	308,047.66
负债总计	-	-	-	6,167,396.70	6,167,396.70
利率敏感度缺口	5,019,693.92	-	-	63,441,605.04	68,461,298.96

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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	1,868,080.73	2.57	4,571.00	0.01
交易性金融资产—基金投资	66,715,930.98	91.75	64,904,248.37	94.80
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	68,584,011.71	94.32	64,908,819.37	94.81

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）
	业绩比较基准上升 5%	3,594,936.96
业绩比较基准下降 5%	-3,594,936.96	

注：于 2013 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 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 68,472,423.21 元，属于第二层级的余额为 111,588.50 元，无属于第三层级的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层级 64,904,248.37 元，第二层级 4,571.00 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	1,868,080.73	2.51
	其中：股票	1,868,080.73	2.51
2	基金投资	66,715,930.98	89.53
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	4,351,361.61	5.84
8	其他各项资产	1,583,764.34	2.13
	合计	74,519,137.66	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	36,323.50	0.05
B	采矿业	55,936.00	0.08
C	制造业	1,164,068.04	1.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,734.00	0.07
E	建筑业	48,294.00	0.07
F	批发和零售业	122,911.40	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	46,507.10	0.06
H	住宿和餐饮业	3,282.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	98,315.59	0.14
J	金融业	20,969.00	0.03
K	房地产业	132,975.60	0.18
L	租赁和商务服务业	27,937.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	8,325.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	16,671.50	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	22,083.00	0.03
S	综合	11,748.00	0.02
	合计	1,868,080.73	2.57

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	600587	新华医疗	200	14,910.00	0.02
2	600570	恒生电子	500	14,700.00	0.02

3	002551	尚荣医疗	400	13,604.00	0.02
4	002190	成飞集成	200	11,800.00	0.02
5	002153	石基信息	200	10,260.00	0.01
6	600201	金宇集团	300	9,336.00	0.01
7	601012	隆基股份	600	9,300.00	0.01
8	002022	科华生物	400	9,220.00	0.01
9	002340	格林美	800	8,952.00	0.01
10	600557	康缘药业	300	8,610.00	0.01
11	600312	平高电气	600	8,364.00	0.01
12	600645	中源协和	300	8,325.00	0.01
13	600879	航天电子	700	8,246.00	0.01
14	000998	隆平高科	300	8,244.00	0.01
15	002063	远光软件	400	8,180.00	0.01
16	600418	江淮汽车	800	8,160.00	0.01
17	000559	万向钱潮	789	8,110.92	0.01
18	000049	德赛电池	200	8,034.00	0.01
19	000028	国药一致	200	7,990.00	0.01
20	002250	联化科技	550	7,810.00	0.01
21	600694	大商股份	300	7,659.00	0.01
22	601099	太平洋	1,200	7,644.00	0.01
23	002005	德豪润达	900	7,533.00	0.01
24	600967	北方创业	600	7,530.00	0.01
25	600872	中炬高新	700	7,469.00	0.01
26	002440	闰土股份	400	7,400.00	0.01
27	600398	海澜之家	800	7,360.00	0.01
28	600260	凯乐科技	1,100	7,249.00	0.01
29	600759	正和股份	700	7,154.00	0.01
30	600584	长电科技	800	7,064.00	0.01
31	000977	浪潮信息	200	7,036.00	0.01
32	600511	国药股份	300	6,810.00	0.01
33	600478	科力远	300	6,798.00	0.01
34	600059	古越龙山	850	6,774.50	0.01
35	000511	烯碳新材	1,000	6,740.00	0.01
36	002405	四维图新	400	6,648.00	0.01
37	600525	长园集团	600	6,624.00	0.01
38	002219	恒康医疗	300	6,594.00	0.01
39	600522	中天科技	500	6,545.00	0.01
40	600138	中青旅	300	6,534.00	0.01
41	600517	置信电气	640	6,502.40	0.01

42	600770	综艺股份	700	6,482.00	0.01
43	002152	广电运通	380	6,475.20	0.01
44	600643	爱建股份	700	6,433.00	0.01
45	002635	安洁科技	200	6,398.00	0.01
46	600582	天地科技	800	6,376.00	0.01
47	600654	飞乐股份	700	6,335.00	0.01
48	600037	歌华有线	600	6,312.00	0.01
49	600422	昆明制药	300	6,303.00	0.01
50	600200	江苏吴中	600	6,234.00	0.01
51	600601	方正科技	1,900	6,061.00	0.01
52	002701	奥瑞金	300	6,051.00	0.01
53	000712	锦龙股份	400	5,972.00	0.01
54	002048	宁波华翔	400	5,960.00	0.01
55	600410	华胜天成	500	5,945.00	0.01
56	600881	亚泰集团	1,600	5,888.00	0.01
57	600820	隧道股份	1,200	5,820.00	0.01
58	000550	江铃汽车	200	5,796.00	0.01
59	600432	吉恩镍业	400	5,776.00	0.01
60	600175	美都控股	1,000	5,750.00	0.01
61	600811	东方集团	1,100	5,709.00	0.01
62	002266	浙富控股	800	5,672.00	0.01
63	000988	华工科技	600	5,634.00	0.01
64	600158	中体产业	600	5,628.00	0.01
65	002396	星网锐捷	200	5,598.00	0.01
66	600747	大连控股	900	5,589.00	0.01
67	002004	华邦颖泰	300	5,580.00	0.01
68	002041	登海种业	200	5,568.00	0.01
69	600038	哈飞股份	200	5,566.00	0.01
70	600572	康恩贝	400	5,548.00	0.01
71	600675	中华企业	1,140	5,529.00	0.01
72	600139	西部资源	400	5,520.00	0.01
73	600161	天坛生物	300	5,514.00	0.01
73	600805	XD 悦达投	600	5,514.00	0.01
74	000897	津滨发展	1,100	5,511.00	0.01
75	002273	水晶光电	300	5,490.00	0.01
76	000848	承德露露	275	5,464.25	0.01
77	600261	阳光照明	550	5,434.00	0.01
78	600151	航天机电	700	5,348.00	0.01
79	600776	东方通信	400	5,340.00	0.01

80	002191	劲嘉股份	400	5,320.00	0.01
81	600757	长江传媒	600	5,310.00	0.01
82	002573	国电清新	300	5,274.00	0.01
83	600635	大众公用	1,100	5,269.00	0.01
84	600110	中科英华	1,000	5,250.00	0.01
85	600787	中储股份	400	5,228.00	0.01
86	002309	中利科技	300	5,217.00	0.01
87	000997	新大陆	300	5,208.00	0.01
88	600651	飞乐音响	700	5,180.00	0.01
88	000939	凯迪电力	700	5,180.00	0.01
89	600884	杉杉股份	300	5,157.00	0.01
90	002437	誉衡药业	100	5,150.00	0.01
91	600112	天成控股	400	5,128.00	0.01
92	600612	老凤祥	200	5,062.00	0.01
93	600699	均胜电子	200	5,026.00	0.01
94	000541	佛山照明	500	4,980.00	0.01
95	002271	东方雨虹	200	4,970.00	0.01
96	002092	中泰化学	800	4,944.00	0.01
97	002424	贵州百灵	200	4,932.00	0.01
98	600183	生益科技	800	4,928.00	0.01
99	600673	东阳光科	400	4,900.00	0.01
99	600435	北方导航	400	4,900.00	0.01
100	000735	罗牛山	800	4,896.00	0.01
101	600490	鹏欣资源	800	4,888.00	0.01
102	002428	云南锗业	400	4,852.00	0.01
103	002223	鱼跃医疗	200	4,850.00	0.01
104	600978	宜华木业	990	4,831.20	0.01
105	000887	中鼎股份	500	4,830.00	0.01
106	600765	中航重机	400	4,800.00	0.01
107	600797	浙大网新	700	4,795.00	0.01
108	002073	软控股份	500	4,785.00	0.01
109	002049	同方国芯	200	4,750.00	0.01
110	000809	铁岭新城	400	4,748.00	0.01
111	002181	粤传媒	300	4,740.00	0.01
111	000852	江钻股份	300	4,740.00	0.01
112	000513	丽珠集团	100	4,723.00	0.01
113	002595	豪迈科技	100	4,715.00	0.01
114	600284	浦东建设	500	4,705.00	0.01
115	600835	上海机电	300	4,674.00	0.01

116	600566	洪城股份	200	4,620.00	0.01
117	000969	安泰科技	500	4,600.00	0.01
117	600351	亚宝药业	500	4,600.00	0.01
118	002690	美亚光电	130	4,585.10	0.01
119	600596	新安股份	500	4,575.00	0.01
120	000788	北大医药	300	4,554.00	0.01
121	600387	海越股份	300	4,524.00	0.01
122	600500	中化国际	700	4,508.00	0.01
123	002155	辰州矿业	600	4,488.00	0.01
124	601777	力帆股份	700	4,473.00	0.01
125	600198	大唐电信	300	4,470.00	0.01
126	600320	振华重工	1,400	4,466.00	0.01
127	600366	宁波韵升	300	4,452.00	0.01
128	600521	华海药业	400	4,420.00	0.01
129	002714	牧原股份	100	4,405.00	0.01
130	000671	阳光城	500	4,395.00	0.01
131	600885	宏发股份	200	4,394.00	0.01
132	000566	海南海药	400	4,352.00	0.01
133	600816	安信信托	300	4,320.00	0.01
133	600426	华鲁恒升	600	4,320.00	0.01
134	600536	中国软件	200	4,300.00	0.01
135	000669	金鸿能源	250	4,295.00	0.01
136	002315	焦点科技	100	4,266.00	0.01
137	600056	中国医药	400	4,252.00	0.01
138	002118	紫鑫药业	300	4,245.00	0.01
138	002638	勤上光电	300	4,245.00	0.01
139	002508	老板电器	150	4,240.50	0.01
140	000829	天音控股	500	4,230.00	0.01
141	000762	西藏矿业	400	4,216.00	0.01
142	002069	獐子岛	300	4,194.00	0.01
143	000919	金陵药业	300	4,176.00	0.01
144	002249	大洋电机	300	4,170.00	0.01
145	000697	炼石有色	300	4,149.00	0.01
146	600704	物产中大	500	4,140.00	0.01
147	000786	北新建材	300	4,116.00	0.01
148	600545	新疆城建	500	4,100.00	0.01
149	002672	东江环保	150	4,099.50	0.01
150	000690	宝新能源	1,000	4,080.00	0.01
150	600503	华丽家族	1,000	4,080.00	0.01

150	600171	上海贝岭	500	4,080.00	0.01
151	000528	柳 工	700	4,074.00	0.01
152	002368	太极股份	121	4,052.29	0.01
153	601519	大智慧	690	4,050.30	0.01
154	000759	中百集团	500	4,050.00	0.01
155	600509	天富热电	500	4,035.00	0.01
156	002371	七星电子	200	4,012.00	0.01
157	000422	湖北宜化	800	4,008.00	0.01
158	002317	众生药业	200	3,994.00	0.01
159	600122	宏图高科	800	3,984.00	0.01
160	600169	太原重工	1,400	3,976.00	0.01
161	000510	金路集团	600	3,942.00	0.01
161	600611	大众交通	600	3,942.00	0.01
162	600761	安徽合力	400	3,936.00	0.01
163	600481	双良节能	400	3,908.00	0.01
163	600729	重庆百货	200	3,908.00	0.01
164	600825	新华传媒	500	3,905.00	0.01
165	600240	华业地产	800	3,904.00	0.01
166	002056	横店东磁	200	3,892.00	0.01
167	600160	巨化股份	800	3,872.00	0.01
168	002183	怡 亚 通	500	3,865.00	0.01
169	600125	铁龙物流	800	3,856.00	0.01
170	002161	远 望 谷	500	3,850.00	0.01
171	000415	渤海租赁	500	3,840.00	0.01
172	600580	卧龙电气	500	3,835.00	0.01
173	600416	湘电股份	400	3,828.00	0.01
174	000616	亿城投资	1,200	3,816.00	0.01
175	600292	中电远达	200	3,808.00	0.01
176	002444	巨星科技	400	3,800.00	0.01
177	600636	三爱富	300	3,789.00	0.01
178	002477	雏鹰农牧	400	3,764.00	0.01
179	600720	祁连山	600	3,762.00	0.01
180	002028	思源电气	400	3,760.00	0.01
181	000050	深天马 A	300	3,750.00	0.01
182	600266	北京城建	500	3,735.00	0.01
183	600325	XD 华发股	600	3,726.00	0.01
184	000078	海王生物	500	3,705.00	0.01
185	002168	深圳惠程	500	3,670.00	0.01
186	000877	天山股份	600	3,666.00	0.01

187	000006	深振业 A	800	3,664.00	0.01
187	600187	国中水务	800	3,664.00	0.01
188	000612	焦作万方	600	3,648.00	0.01
189	000823	超声电子	300	3,639.00	0.01
190	002414	高德红外	200	3,638.00	0.01
191	600073	上海梅林	500	3,635.00	0.00
192	000982	中银绒业	500	3,625.00	0.00
193	600270	外运发展	300	3,624.00	0.00
194	002216	三全食品	200	3,610.00	0.00
195	600392	盛和资源	200	3,596.00	0.00
195	002052	同洲电子	400	3,596.00	0.00
196	600487	亨通光电	250	3,595.00	0.00
197	600790	轻纺城	400	3,592.00	0.00
198	002663	普邦园林	300	3,588.00	0.00
199	600289	亿阳信通	400	3,580.00	0.00
200	600086	东方金钰	200	3,572.00	0.00
201	000540	中天城投	700	3,570.00	0.00
202	600220	江苏阳光	1,200	3,564.00	0.00
203	002431	棕榈园林	200	3,560.00	0.00
204	000088	盐田港	700	3,556.00	0.00
205	600458	时代新材	400	3,528.00	0.00
206	000726	鲁泰 A	400	3,516.00	0.00
207	000501	鄂武商 A	300	3,510.00	0.00
207	002179	中航光电	200	3,510.00	0.00
208	600067	冠城大通	700	3,507.00	0.00
209	600409	三友化工	800	3,496.00	0.00
210	000488	晨鸣纸业	800	3,488.00	0.00
211	000652	泰达股份	900	3,483.00	0.00
212	002050	三花股份	320	3,475.20	0.00
213	000933	神火股份	1,000	3,460.00	0.00
214	600640	号百控股	200	3,448.00	0.00
215	002281	光迅科技	100	3,439.00	0.00
216	600812	华北制药	700	3,437.00	0.00
217	600460	士兰微	580	3,433.60	0.00
218	600685	广船国际	200	3,426.00	0.00
219	002345	潮宏基	200	3,424.00	0.00
219	002064	华峰氨纶	400	3,424.00	0.00
220	601717	郑煤机	700	3,402.00	0.00
221	002018	华星化工	400	3,392.00	0.00

222	600120	浙江东方	300	3,390.00	0.00
223	600017	日照港	1,300	3,367.00	0.00
224	601369	陕鼓动力	600	3,366.00	0.00
224	002140	东华科技	200	3,366.00	0.00
225	601002	晋亿实业	400	3,360.00	0.00
226	600551	时代出版	200	3,334.00	0.00
227	000572	海马汽车	900	3,330.00	0.00
228	600563	法拉电子	100	3,325.00	0.00
229	002557	洽洽食品	200	3,316.00	0.00
230	600894	广日股份	300	3,309.00	0.00
231	002311	海大集团	300	3,303.00	0.00
232	000543	皖能电力	500	3,300.00	0.00
233	002572	索菲亚	200	3,288.00	0.00
234	600754	锦江股份	200	3,282.00	0.00
235	002325	洪涛股份	400	3,280.00	0.00
236	600389	江山股份	100	3,261.00	0.00
237	000926	福星股份	500	3,260.00	0.00
238	600851	海欣股份	500	3,245.00	0.00
239	002029	七匹狼	400	3,232.00	0.00
240	600064	南京高科	300	3,225.00	0.00
241	000777	中核科技	280	3,217.20	0.00
242	601311	骆驼股份	300	3,216.00	0.00
243	600482	风帆股份	300	3,210.00	0.00
244	601718	际华集团	1,300	3,198.00	0.00
245	000975	银泰资源	400	3,188.00	0.00
246	600874	创业环保	400	3,180.00	0.00
247	002011	盾安环境	400	3,172.00	0.00
248	000973	佛塑科技	600	3,168.00	0.00
248	000830	鲁西化工	900	3,168.00	0.00
249	600859	王府井	200	3,160.00	0.00
250	600993	马应龙	200	3,142.00	0.00
250	600335	国机汽车	200	3,142.00	0.00
251	600702	沱牌舍得	300	3,141.00	0.00
252	002025	航天电器	200	3,138.00	0.00
253	600750	江中药业	200	3,134.00	0.00
254	600740	山西焦化	600	3,132.00	0.00
255	000636	风华高科	500	3,120.00	0.00
256	000587	金叶珠宝	300	3,114.00	0.00
257	002262	恩华药业	140	3,109.40	0.00

258	600628	新世界	400	3,104.00	0.00
259	600329	中新药业	200	3,098.00	0.00
259	002646	青青稞酒	200	3,098.00	0.00
260	600831	广电网络	400	3,092.00	0.00
261	000090	天健集团	400	3,084.00	0.00
262	002447	壹桥苗业	250	3,072.50	0.00
263	002123	荣信股份	400	3,068.00	0.00
264	601000	唐山港	700	3,066.00	0.00
265	002091	江苏国泰	200	3,062.00	0.00
266	600639	浦东金桥	300	3,054.00	0.00
267	000685	中山公用	300	3,051.00	0.00
268	002275	桂林三金	200	3,036.00	0.00
269	002384	东山精密	300	3,033.00	0.00
270	000886	海南高速	700	3,031.00	0.00
271	000816	江淮动力	700	3,024.00	0.00
271	600380	健康元	600	3,024.00	0.00
272	600251	冠农股份	200	2,990.00	0.00
273	600132	重庆啤酒	200	2,984.00	0.00
274	600575	芜湖港	800	2,976.00	0.00
275	600748	上实发展	400	2,972.00	0.00
276	000979	中弘股份	1,000	2,970.00	0.00
277	600456	宝钛股份	200	2,968.00	0.00
278	600826	兰生股份	200	2,964.00	0.00
278	002242	九阳股份	300	2,964.00	0.00
279	002013	中航机电	200	2,962.00	0.00
280	000021	长城开发	500	2,950.00	0.00
281	600141	兴发集团	300	2,943.00	0.00
282	002393	力生制药	100	2,919.00	0.00
283	600298	安琪酵母	200	2,916.00	0.00
284	000667	美好集团	1,700	2,907.00	0.00
285	600401	海润光伏	364	2,904.72	0.00
286	600088	中视传媒	200	2,904.00	0.00
287	600311	荣华实业	600	2,892.00	0.00
288	000518	四环生物	900	2,889.00	0.00
289	002285	世联行	360	2,883.60	0.00
290	000426	兴业矿业	300	2,868.00	0.00
291	002648	卫星石化	200	2,862.00	0.00
291	000962	东方钽业	300	2,862.00	0.00
292	002277	友阿股份	300	2,850.00	0.00

293	600438	通威股份	300	2,847.00	0.00
294	600507	方大特钢	900	2,844.00	0.00
295	601126	四方股份	200	2,840.00	0.00
296	600300	维维股份	700	2,828.00	0.00
297	002461	珠江啤酒	200	2,824.00	0.00
298	600004	白云机场	400	2,816.00	0.00
299	000900	现代投资	610	2,812.10	0.00
300	000860	顺鑫农业	200	2,808.00	0.00
301	600199	金种子酒	400	2,804.00	0.00
302	000525	红太阳	200	2,802.00	0.00
303	002408	齐翔腾达	200	2,788.00	0.00
304	002332	仙琚制药	350	2,786.00	0.00
305	600528	中铁二局	600	2,778.00	0.00
306	002032	苏泊尔	200	2,738.00	0.00
307	600322	天房发展	800	2,736.00	0.00
308	600970	中材国际	400	2,728.00	0.00
309	001696	宗申动力	600	2,718.00	0.00
310	603366	日出东方	200	2,702.00	0.00
311	601801	皖新传媒	200	2,674.00	0.00
312	002308	威创股份	400	2,672.00	0.00
313	600971	恒源煤电	500	2,670.00	0.00
314	002588	史丹利	130	2,665.00	0.00
315	000099	中信海直	300	2,658.00	0.00
316	603766	隆鑫通用	300	2,652.00	0.00
317	000931	中关村	500	2,630.00	0.00
318	600586	金晶科技	900	2,628.00	0.00
319	600021	上海电力	600	2,622.00	0.00
320	600997	开滦股份	600	2,616.00	0.00
321	600496	精工钢构	400	2,612.00	0.00
322	000921	海信科龙	300	2,610.00	0.00
323	000031	中粮地产	800	2,608.00	0.00
324	600864	哈投股份	300	2,604.00	0.00
325	601011	宝泰隆	200	2,602.00	0.00
325	600195	中牧股份	200	2,602.00	0.00
326	002128	露天煤业	400	2,600.00	0.00
326	603077	和邦股份	200	2,600.00	0.00
327	000930	中粮生化	700	2,597.00	0.00
328	600983	合肥三洋	200	2,596.00	0.00
329	000417	合肥百货	500	2,585.00	0.00

330	000850	华茂股份	500	2,580.00	0.00
330	000030	富奥股份	400	2,580.00	0.00
331	002251	步步高	200	2,576.00	0.00
332	000563	陕国投 A	400	2,572.00	0.00
333	000680	山推股份	900	2,565.00	0.00
334	600823	世茂股份	300	2,562.00	0.00
334	000732	泰禾集团	300	2,562.00	0.00
335	002237	恒邦股份	200	2,554.00	0.00
336	002204	大连重工	200	2,552.00	0.00
337	600054	黄山旅游	200	2,550.00	0.00
337	002194	武汉凡谷	200	2,550.00	0.00
338	002574	明牌珠宝	100	2,549.00	0.00
339	603555	贵人鸟	200	2,546.00	0.00
340	002254	泰和新材	300	2,535.00	0.00
341	000066	长城电脑	600	2,532.00	0.00
342	002276	万马股份	400	2,524.00	0.00
343	002238	天威视讯	200	2,506.00	0.00
344	601886	江河创建	400	2,500.00	0.00
345	002698	博实股份	100	2,492.00	0.00
346	002358	森源电气	100	2,486.00	0.00
347	601965	中国汽研	200	2,474.00	0.00
348	002083	孚日股份	600	2,454.00	0.00
349	600755	厦门国贸	500	2,425.00	0.00
350	600026	中海发展	600	2,424.00	0.00
351	002482	广田股份	200	2,394.00	0.00
352	601515	东风股份	200	2,376.00	0.00
353	000650	仁和药业	500	2,375.00	0.00
354	600844	丹化科技	400	2,372.00	0.00
355	000719	大地传媒	200	2,370.00	0.00
356	000693	华泽钴镍	100	2,368.00	0.00
357	601880	大连港	900	2,367.00	0.00
358	600508	上海能源	300	2,364.00	0.00
359	000627	天茂集团	900	2,358.00	0.00
360	600425	青松建化	500	2,355.00	0.00
361	000951	中国重汽	200	2,354.00	0.00
362	002122	天马股份	500	2,350.00	0.00
363	600616	金枫酒业	300	2,340.00	0.00
364	600803	威远生化	200	2,336.00	0.00
365	600736	苏州高新	600	2,334.00	0.00

366	600439	瑞贝卡	600	2,328.00	0.00
366	600176	中国玻纤	300	2,328.00	0.00
367	600180	瑞茂通	220	2,321.00	0.00
368	600830	香溢融通	300	2,310.00	0.00
368	002479	富春环保	300	2,310.00	0.00
369	600479	千金药业	200	2,306.00	0.00
370	600337	美克股份	400	2,296.00	0.00
371	002244	滨江集团	400	2,268.00	0.00
372	601101	昊华能源	400	2,252.00	0.00
373	601678	滨化股份	300	2,244.00	0.00
374	002221	东华能源	200	2,238.00	0.00
375	600078	澄星股份	400	2,232.00	0.00
375	600039	四川路桥	400	2,232.00	0.00
376	002203	海亮股份	200	2,202.00	0.00
377	600449	宁夏建材	300	2,196.00	0.00
378	601608	中信重工	700	2,191.00	0.00
379	600888	新疆众和	400	2,184.00	0.00
380	000799	酒鬼酒	200	2,182.00	0.00
381	600467	好当家	400	2,180.00	0.00
382	600429	三元股份	300	2,169.00	0.00
383	601388	怡球资源	200	2,158.00	0.00
384	002480	新筑股份	300	2,157.00	0.00
385	600239	云南城投	500	2,155.00	0.00
386	002342	巨力索具	400	2,152.00	0.00
387	601636	旗滨集团	300	2,148.00	0.00
388	601616	广电电气	600	2,142.00	0.00
389	601908	京运通	300	2,139.00	0.00
390	600801	华新水泥	320	2,134.40	0.00
391	002226	江南化工	200	2,122.00	0.00
392	600184	光电股份	100	2,110.00	0.00
393	601566	九牧王	200	2,108.00	0.00
394	600858	银座股份	300	2,103.00	0.00
395	600006	东风汽车	700	2,086.00	0.00
396	002489	浙江永强	200	2,084.00	0.00
397	600333	长春燃气	300	2,073.00	0.00
398	600537	亿晶光电	200	2,064.00	0.00
399	000655	金岭矿业	300	2,061.00	0.00
400	600428	中远航运	700	2,051.00	0.00
401	002430	杭氧股份	300	2,043.00	0.00

402	000418	小天鹅 A	200	2,042.00	0.00
403	601208	东材科技	300	2,025.00	0.00
404	600280	中央商场	200	2,018.00	0.00
405	002293	罗莱家纺	100	2,010.00	0.00
406	002612	朗姿股份	100	2,008.00	0.00
406	600614	鼎立股份	200	2,008.00	0.00
407	600468	百利电气	200	1,992.00	0.00
408	600683	京投银泰	400	1,988.00	0.00
409	002093	国脉科技	300	1,983.00	0.00
410	600773	西藏城投	200	1,978.00	0.00
411	000703	恒逸石化	300	1,977.00	0.00
412	600850	华东电脑	100	1,956.00	0.00
413	000506	中润资源	500	1,930.00	0.00
414	000861	海印股份	200	1,918.00	0.00
415	600737	中粮屯河	400	1,912.00	0.00
416	000596	古井贡酒	100	1,907.00	0.00
417	600657	信达地产	600	1,902.00	0.00
418	002419	天虹商场	200	1,900.00	0.00
419	002078	太阳纸业	600	1,890.00	0.00
420	002678	珠江钢琴	200	1,870.00	0.00
421	600094	大名城	300	1,866.00	0.00
422	600162	香江控股	400	1,856.00	0.00
423	601100	恒立油缸	200	1,852.00	0.00
424	002601	佰利联	100	1,850.00	0.00
425	600723	首商股份	300	1,842.00	0.00
426	601233	桐昆股份	300	1,839.00	0.00
427	002392	北京利尔	200	1,838.00	0.00
428	600815	厦工股份	500	1,825.00	0.00
429	000987	广州友谊	200	1,822.00	0.00
430	000409	山东地矿	200	1,820.00	0.00
430	002267	陕天然气	200	1,820.00	0.00
431	002233	塔牌集团	300	1,818.00	0.00
432	002305	南国置业	300	1,815.00	0.00
433	002463	沪电股份	560	1,808.80	0.00
434	600197	伊力特	200	1,808.00	0.00
435	600963	岳阳林纸	600	1,806.00	0.00
436	002327	富安娜	160	1,780.80	0.00
437	002320	海峡股份	200	1,764.00	0.00
438	002378	章源钨业	100	1,758.00	0.00

439	002154	报喜鸟	300	1,737.00	0.00
440	600488	天药股份	400	1,732.00	0.00
441	600780	通宝能源	400	1,724.00	0.00
442	002490	山东墨龙	200	1,700.00	0.00
443	000620	新华联	300	1,683.00	0.00
444	600491	龙元建设	500	1,645.00	0.00
445	600869	远东电缆	200	1,630.00	0.00
446	000552	靖远煤电	200	1,624.00	0.00
447	601339	百隆东方	200	1,618.00	0.00
448	002662	京威股份	200	1,606.00	0.00
449	601999	出版传媒	200	1,586.00	0.00
450	600724	宁波富达	400	1,576.00	0.00
450	000780	平庄能源	400	1,576.00	0.00
451	000688	建新矿业	300	1,563.00	0.00
452	600510	黑牡丹	300	1,560.00	0.00
453	002075	沙钢股份	400	1,540.00	0.00
454	002705	新宝股份	100	1,494.00	0.00
455	600268	国电南自	300	1,488.00	0.00
456	600618	氯碱化工	200	1,486.00	0.00
457	002498	汉缆股份	200	1,436.00	0.00
458	000927	一汽夏利	400	1,428.00	0.00
459	601010	文峰股份	200	1,396.00	0.00
460	600743	华远地产	500	1,390.00	0.00
461	603001	奥康国际	100	1,375.00	0.00
462	600397	安源煤业	400	1,356.00	0.00
462	000631	顺发恒业	300	1,356.00	0.00
463	002534	杭锅股份	100	1,341.00	0.00
464	000603	盛达矿业	100	1,181.00	0.00
465	000935	四川双马	225	1,172.25	0.00
466	002503	搜于特	140	1,148.00	0.00
467	002225	濮耐股份	200	1,058.00	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	002008	大族激光	160,096.93	0.23
2	600499	科达洁能	149,249.00	0.22
3	601929	吉视传媒	144,604.40	0.21
4	600570	恒生电子	138,801.00	0.20
5	600872	中炬高新	137,954.69	0.20
6	600594	益佰制药	137,203.65	0.20
7	600879	航天电子	133,094.00	0.19
8	600312	平高电气	131,121.00	0.19
9	002465	海格通信	130,924.00	0.19
10	002400	省广股份	128,863.26	0.19
11	600388	龙净环保	121,391.00	0.18
12	600643	爱建股份	119,739.00	0.17
13	600770	综艺股份	119,147.00	0.17
14	600557	康缘药业	119,010.00	0.17
15	000559	万向钱潮	117,170.00	0.17
16	000998	隆平高科	116,756.00	0.17
17	000897	津滨发展	113,794.00	0.17
18	600517	置信电气	111,446.62	0.16
19	002440	闰土股份	111,380.00	0.16
20	600635	大众公用	108,476.00	0.16

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	002008	大族激光	152,728.68	0.22
2	600499	科达洁能	147,500.31	0.22
3	600570	恒生电子	136,771.77	0.20
4	601929	吉视传媒	136,055.30	0.20
5	002465	海格通信	134,160.60	0.20
6	600872	中炬高新	130,445.31	0.19
7	002400	省广股份	127,752.04	0.19
8	600557	康缘药业	123,615.46	0.18
9	600879	航天电子	122,245.72	0.18
10	600312	平高电气	120,869.48	0.18
11	000998	隆平高科	119,502.62	0.17
12	600388	龙净环保	119,067.00	0.17

13	600643	爱建股份	118,268.83	0.17
14	600770	综艺股份	117,557.24	0.17
15	600594	益佰制药	114,031.06	0.17
16	600880	博瑞传播	108,610.86	0.16
17	600881	亚泰集团	107,979.06	0.16
18	000897	津滨发展	105,532.67	0.15
19	600635	大众公用	102,818.06	0.15
20	600522	中天科技	102,513.80	0.15

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	24,966,234.49
卖出股票收入（成交）总额	23,595,479.21

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	嘉实中证 500ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限	66,715,930.98	91.75

				公司		
--	--	--	--	----	--	--

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，在本报告编制日以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	14,513.45
2	应收证券清算款	1,394,500.67
3	应收股利	-
4	应收利息	921.11
5	应收申购款	173,829.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,583,764.34

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	13,604.00	0.02	重大事项停牌
2	601012	隆基股份	9,300.00	0.01	重大事项停牌
3	002340	格林美	8,952.00	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
3,837	16,955.82	560,460.29	0.86%	64,499,018.66	99.14%

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	436.94	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 (2013 年 3 月 22 日) 基金份额总额	292,915,388.83
本报告期期初基金份额总额	62,555,323.84
本报告期基金总申购份额	58,284,419.53
减:本报告期基金总赎回份额	55,780,264.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	65,059,478.95

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

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

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	
申银万国证券股份有限公司	1	26,480,314.59	54.53%	18,536.49	54.51%	-
中信证券股份有限公司	2	20,861,232.11	42.96%	14,613.78	42.97%	-
国信证券股份有限公司	1	1,218,844.30	2.51%	856.04	2.52%	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	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，能及时提供准确的信息资讯服务。

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。

注 3：报告期内，本基金退租以下交易单元：信达证券股份有限公司上海交易单元 1 个、国都证券有限责任公司上海交易单元 1 个。

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	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

	告		
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
6	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) 中国证监会核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
- (2) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 500 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

- (1) 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) 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2014 年 8 月 25 日