

# 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2014 年年度报告

2014 年 12 月 31 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：2015 年 3 月 31 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 2015 年 3 月 26 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。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>13</b>
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>14</b>
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
8.3 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.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
8.6 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.....	56
8.7 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.....	56
8.8 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.....	57
8.9 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.....	57

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
8.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
9.4 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 .....	59
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
11.2 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 .....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
11.4 基金投资策略的改变 .....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
11.8 其他重大事件 .....	61
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 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
基金简称	嘉实中证 500ETF
场内简称	500ETF
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	69,731,868.00 份
基金合同存续期	不定期
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

### 2.2 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2014 年	2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	36,702,856.62	24,454,195.20
本期利润	89,901,468.73	34,027,425.03
加权平均基金份额本期利润	1.5002	0.0806
本期加权平均净值利润率	34.23%	3.55%
本期基金份额净值增长率	38.49%	7.58%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	67,920,941.06	17,633,620.55
期末可供分配基金份额利润	0.9740	0.2703
期末基金资产净值	370,524,557.03	250,287,144.92
期末基金份额净值	5.3136	3.8369
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	48.99%	7.58%

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
过去三个月	7.61%	1.43%	8.27%	1.45%	-0.66%	-0.02%
过去六个月	34.73%	1.21%	35.61%	1.22%	-0.88%	-0.01%
过去一年	38.49%	1.23%	39.01%	1.24%	-0.52%	-0.01%
自基金合同生效起至今	48.99%	1.31%	51.19%	1.34%	-2.20%	-0.03%

### 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 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

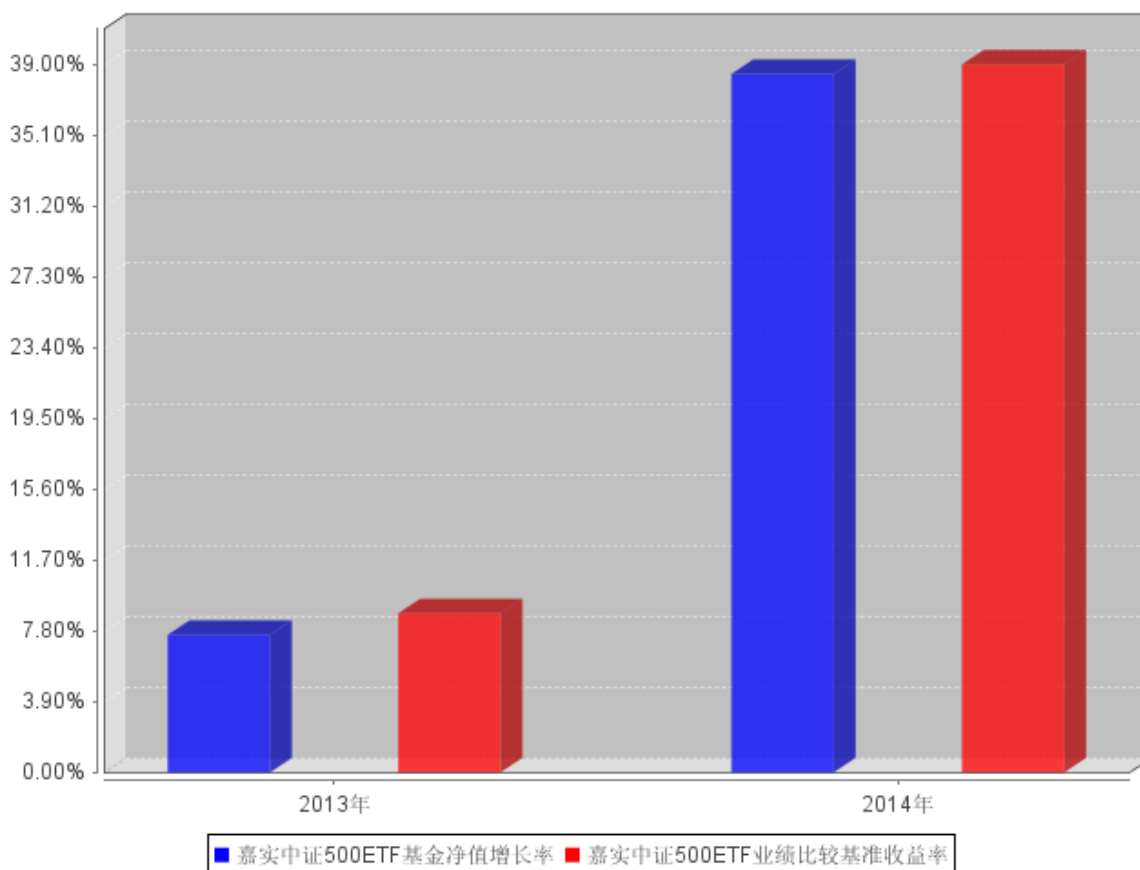
(2013 年 2 月 6 日至 2014 年 12 月 31 日)

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“第十四部分（二）投资范围和（七）投资限制”的有关

约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实中证500ETF自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2013 年 2 月 6 日，2013 年度的相关数据根据当年实际存续期（2013 年 2 月 6 日至 2013 年 12 月 31 日）计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

## § 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。公司注册地在上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。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 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、66 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和封闭、嘉实元和、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 300 指数 (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、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强。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 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、	2013 年 2 月 6 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。

	嘉 实 黄 金 (QDII-FOF-LOF) 基 金经理, 公司指数投 资部总监				
--	---	--	--	--	--

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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》, 按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定, 从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面, 确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合, 杜绝不同投资组合之间进行利益输送, 保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议, 并在投资决策委员会的制度规范下独立决策, 实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离, 任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利, 共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则, 保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易, 严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素, 交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内, 公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

### 4.3.3 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 7 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易，不存在利益输送等异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.02%，年度化拟合偏离度为 0.29%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2%的限制。本基金的跟踪误差主要来源于本基金申购赎回、样本股分红以及样本股调整的冲击。

### 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 5.3136 元；本报告期基金份额净值增长率为 38.49%，业绩比较基准收益率为 39.01%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来中国经济发展必然更加倚重机制创新、技术创新，政府资源、市场资源也会更多地偏向新兴产业和机制灵活市场化程度高的中小型企业。中证 500 指数相对其他主流指数，其中小市值个股占比较大，因此对转型经济中的新兴产业代表性更强。报告期内，中证 500 指数上涨 39.01%。

本基金作为一只投资于中证 500 指数的被动投资管理产品，我们将继续秉承指数化被动投资策略，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，力争进一步降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证 500 指数的投资工具。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置，重点支持创新业务和新产品拓展。创新是公司永恒的主题，同时应有效防控风险，从战略规划到具体产品方案，在投资范围、投资工具、运作规则的创新，使之更加符

合投资者需求，并在投资者利益保护、市场营销方面坚持底线。

(2) 加强差错管理，继续完善公司整体风险架构表，推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制，努力实现适当风险水平下的效益最大化。

(3) 法律事务：除了创新业务的法律支持外，还完成了大量的日常法律事务工作，包括合同、协议审查(包括各类产品及业务)，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(4) 合规管理：主要从事前合规审核、合规监控系统化建设、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

(5) 内部审计：按季度对销售、投资、后台和其它业务开展内审，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。继续发起公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证，全面完成公司及基金的外审等。

此外，我们还积极配合证监会、北京证监局、社保基金理事会的现场检查、以及统计调查工作，按时完成季度、年度监察稽核报告和各项专题报告。

#### 4.7 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基金业协会等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同十八(二)“1. 在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率。截至收益评价日基金净值增长率减去标的指数增长率的差额超过 1%时，基金管理人可以进行收益分配”。

本基金基金合同生效日为 2013 年 2 月 6 日。报告期末基金净值增长率减去标的指数增长率的差额未超过 1%，因此本基金报告期内未实施利润分配，符合基金合同的约定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 审计报告

普华永道中天审字(2015)第 20114 号

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实中证 500ETF 基金”)的财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

#### 一、 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是嘉实中证 500ETF 基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表, 并使其实现公允反映;
- (2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

## 二、 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。

我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。

## 三、 审计意见

我们认为, 上述嘉实中证 500ETF 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的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, 公允反映了嘉实中证 500ETF 基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天  
会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师  
许 康 玮

中国 · 上海市  
2015 年 3 月 18 日

注册会计师  
洪 磊

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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

报告截止日: 2014 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资 产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
-----	-----	-------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,540,818.65	2,473,175.57
结算备付金		4,431.00	10,056.95
存出保证金		3,782.93	7,109.69
交易性金融资产	7.4.7.2	368,819,410.29	248,408,858.24
其中：股票投资		368,819,410.29	248,408,858.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		57,883.98	-
应收利息	7.4.7.5	762.86	556.34
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		371,427,089.71	250,899,756.79
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年12月31日</b>	<b>上年度末 2013年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		161,362.00	108,396.79
应付托管费		32,272.41	21,679.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	80,267.63	70,922.92
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	628,630.64	411,612.80
负债合计		902,532.68	612,611.87
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	248,703,055.05	232,653,524.37
未分配利润	7.4.7.10	121,821,501.98	17,633,620.55
所有者权益合计		370,524,557.03	250,287,144.92
负债和所有者权益总计		371,427,089.71	250,899,756.79

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.3136 元，基金份额总额 69,731,868.00 份。

## 7.2 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

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 2 月 6 日(基金 合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		92,338,291.08	44,871,510.73
1.利息收入		17,500.83	2,706,225.02
其中：存款利息收入	7.4.7.11	17,403.62	452,830.96
债券利息收入		97.21	88.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	2,253,305.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益		38,921,920.95	32,602,343.36
其中：股票投资收益	7.4.7.12	36,891,153.41	25,912,097.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	23,266.79	4,573.44
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,007,500.75	6,685,672.33
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	53,198,612.11	9,573,229.83
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	200,257.19	-10,287.48
<b>减：二、费用</b>		2,436,822.35	10,844,085.70
1. 管理人报酬		1,314,104.38	4,414,218.42
2. 托管费		262,820.90	882,843.69
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	237,495.51	4,804,547.37
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	622,401.56	742,476.22
<b>三、利润总额</b>		89,901,468.73	34,027,425.03
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		89,901,468.73	34,027,425.03

注：本基金合同生效日为 2013 年 2 月 6 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2013 年 2 月 6 日至 2013 年 12 月 31 日。



### 7.3 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

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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）	232,653,524.37	17,633,620.55	250,287,144.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	89,901,468.73	89,901,468.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	16,049,530.68	14,286,412.70	30,335,943.38
其中：1.基金申购款	155,680,446.70	48,106,606.89	203,787,053.59
2.基金赎回款	-139,630,916.02	-33,820,194.19	-173,451,110.21
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）	248,703,055.05	121,821,501.98	370,524,557.03
项目	上年度可比期间 2013 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 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）	3,108,729,402.00	-	3,108,729,402.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,027,425.03	34,027,425.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,876,075,877.63	-16,393,804.48	-2,892,469,682.11
其中：1.基金申购款	105,926,901.77	1,332,503.57	107,259,405.34
2.基金赎回款	-2,982,002,779.40	-17,726,308.05	-2,999,729,087.45
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）	232,653,524.37	17,633,620.55	250,287,144.92

注：本基金合同生效日为 2013 年 2 月 6 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2013 年 2 月 6 日至 2013 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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(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基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,108,591,728.00 元(含募集股票市值)，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 047 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基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,108,729,402.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 137,674.00 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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上 [2013] 83 号文审核同意，本基金 871,631,868.00 份基金份额于 2013 年 3 月 15 日在深交所挂牌交易。

根据《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额折算的公告》(以下简称“份额折算公告”)的有关规定，本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司确定 2013 年 3 月 5 日为本基金的基金折算处理日。当日基金资产净值为 3,136,108,366.93 元，折算前基金份额总额为 3,108,729,402.00 份，折算前基金份额净值为 1.0088 元。根据份额折算公告中的基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.28038605，折算后基金份额总额为 871,631,868.00 份，折算后基金份额净值为 3.5980 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算，并于 2013 年 3 月 6 日进行了变更登记。

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基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数，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%。本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。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。

本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“嘉实中证 500ETF 联接基金”)。嘉实中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

#### 7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益

分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日(即收益评价日)

的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。本基金收益分配采取现金分红。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、

经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

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

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则的施行对本基金本报告期及上年度可比期间无重大影响。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### **7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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、债券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、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	2,540,818.65	2,473,175.57
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	2,540,818.65	2,473,175.57

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	306,047,568.35	368,819,410.29	62,771,841.94



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	-	-	-
其他	-	-	-
合计	306,047,568.35	368,819,410.29	62,771,841.94
项目	上年度末 2013年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	238,835,628.41	248,408,858.24	9,573,229.83
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	-	-	-
其他	-	-	-
合计	238,835,628.41	248,408,858.24	9,573,229.83

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2014年12月31日）及上年度末（2013年12月31日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2014年12月31日）及上年度末（2013年12月31日），本基金未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2014年12月31日）及上年度末（2013年12月31日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
应收活期存款利息	712.69	509.70

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	48.30	43.12
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	1.87	3.52
合计	762.86	556.34

#### 7.4.7.6 其他资产

本期末（2014 年 12 月 31 日）及上年度末（2013 年 12 月 31 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	80,267.63	70,922.92
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	80,267.63	70,922.92

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
可退替代款	196,012.45	9,286.30
应付替代款	22,618.19	2,326.50
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
预提费用	360,000.00	350,000.00
合计	628,630.64	411,612.80

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	65,231,868.00	232,653,524.37
本期申购	43,650,000.00	155,680,446.70
本期赎回	-39,150,000.00	-139,630,916.02

本期末	69,731,868.00	248,703,055.05
-----	---------------	----------------

#### 7.4.7.10 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	26,357,624.10	-8,724,003.55	17,633,620.55
本期利润	36,702,856.62	53,198,612.11	89,901,468.73
本期基金份额交易产生的变动数	4,860,460.34	9,425,952.36	14,286,412.70
其中：基金申购款	27,311,192.97	20,795,413.92	48,106,606.89
基金赎回款	-22,450,732.63	-11,369,461.56	-33,820,194.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,920,941.06	53,900,560.92	121,821,501.98

#### 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日
活期存款利息收入	15,155.52	383,839.30
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	2,192.11	63,959.51
其他	55.99	5,032.15
合计	17,403.62	452,830.96

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,547,133.65	22,432,723.54
股票投资收益——赎回差价收入	21,344,019.76	3,479,374.05
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	36,891,153.41	25,912,097.59

##### 7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日
----	-----------------------------	---

卖出股票成交总额	87,154,260.52	913,714,701.82
减：卖出股票成本总额	71,607,126.87	891,281,978.28
买卖股票差价收入	15,547,133.65	22,432,723.54

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年2月6日(基金合 同生效日)至2013年12月31 日
赎回基金份额对价总额	173,451,110.21	2,999,729,087.45
减：现金支付赎回款总额	-100,518.79	27,585,196.45
减：赎回股票成本总额	152,207,609.24	2,968,664,516.95
赎回差价收入	21,344,019.76	3,479,374.05

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年2月6日(基金合同生效 日)至2013年12月31日
卖出债券成交总额	155,364.00	263,662.00
减：卖出债券成本总额	132,000.00	259,000.00
减：应收利息总额	97.21	88.56
买卖债券差价收入	23,266.79	4,573.44

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

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2月6日（基金合同生效日）至2013年12月31日），本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年2月6日(基金合同生效 日)至2013年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,007,500.75	6,685,672.33
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,007,500.75	6,685,672.33

#### 7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2013年2月6日(基金合同 生效日)至2013年12月31日
------	---------------------------------	---

1. 交易性金融资产	53,198,612.11	9,573,229.83
——股票投资	53,198,612.11	9,573,229.83
——债券投资	-	-
——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	53,198,612.11	9,573,229.83

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年2月6日(基金合同生 效日)至2013年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	200,257.19	-21,302.40
募集期利息收入	-	11,014.92
证管费退还	-	-
其他	-	-
合计	200,257.19	-10,287.48

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31 日	上年度可比期间 2013年2月6日(基金合同生效 日)至2013年12月31日
交易所市场交易费用	237,495.51	4,804,547.37
银行间市场交易费用	-	-
合计	237,495.51	4,804,547.37

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月 31日	上年度可比期间 2013年2月6日(基金合同生 效日)至2013年12月31日
审计费用	60,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	270,000.00
银行划款手续费	2,401.56	9,918.10
指数使用费	200,000.00	301,658.12
上市年费	60,000.00	80,000.00
红利手续费	-	-
其他	-	900.00

合计	622,401.56	742,476.22
----	------------	------------

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

### 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实中证 500ETF 联接”）	本基金的联接基金

## 7.4.10 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。

### 7.4.10.1 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 12 月 31 日）及上年度可比期间（2013 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,314,104.38	4,414,218.42
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：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 0.5% 的年费率计提，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 × 0.5% / 当年天数。

### 7.4.10.2 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 12 月 31 日	2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	262,820.90	882,843.69

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.1% / 当年天数。

### 7.4.10.3 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 12 月 31 日）及上年度可比期间（2013 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 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。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 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 12 月 31 日）及上年度可比期间（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2014 年 12 月 31 日		2013 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
嘉实中证 500ETF 联接	46,260,132.00	66.34%	16,915,804.00	25.93%

### 7.4.10.5 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 12 月 31 日		2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 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	2,540,818.65	15,155.52	2,473,175.57	383,839.30

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。

#### 7.4.10.6 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 12 月 31 日）及上年度可比期间（2013 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况

本期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），本基金未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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 12 月 31 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 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
300168	万达信息	2014 年 12 月 31 日	重大事项停牌	46.20	2015 年 1 月 8 日	44.50	45,200	1,730,145.24	2,088,240.00	-
000977	浪潮信息	2014 年 12 月 22 日	重大事项停牌	41.18	2015 年 1 月 19 日	45.30	31,900	971,553.54	1,313,642.00	-
000897	津滨发展	2014 年 12 月 26 日	重大事项停牌	7.55	2015 年 1 月 21 日	7.50	171,372	781,442.83	1,293,858.60	-
600759	洲际油气	2014 年 12 月 24 日	重大事项停牌	9.90	未知	未知	129,427	1,163,610.26	1,281,327.30	-
600490	鹏欣资源	2014 年 12 月 24 日	重大事项停牌	10.79	2015 年 1 月 12 日	11.87	117,307	1,147,857.63	1,265,742.53	-
600584	长电科技	2014 年 11 月 3 日	重大事项停牌	11.13	2015 年 1 月 14 日	12.24	107,004	837,604.88	1,190,954.52	-
300144	宋城演艺	2014 年 12 月 18 日	重大事项停牌	30.12	2015 年 3 月 18 日	33.13	36,800	1,040,143.60	1,108,416.00	-
000612	焦作万方	2014 年 12 月 29 日	重大事项停牌	10.10	2015 年 1 月 16 日	10.20	95,664	767,501.04	966,206.40	-
000616	亿城投资	2014 年 12 月 1 日	重大事项停牌	4.77	未知	未知	196,470	701,786.59	937,161.90	-
002018	华信国际	2014 年 11 月 19 日	重大事项停牌	13.99	2015 年 3 月 6 日	15.39	65,000	587,347.85	909,350.00	-
600428	中远航运	2014 年 12 月 22 日	重大事项停牌	8.00	2015 年 1 月 8 日	8.30	111,852	457,314.62	894,816.00	-
600761	安徽合力	2014 年 12 月 26 日	重大事项停牌	15.65	2015 年 1 月 6 日	16.60	57,063	554,574.34	893,035.95	-



002437	誉衡药业	2014 年 11 月 21 日	重大事项停牌	23.75	2015 年 1 月 26 日	26.13	36,903	595,864.76	876,446.25	-
600240	华业地产	2014 年 10 月 16 日	重大事项停牌	7.19	2015 年 1 月 22 日	7.91	114,581	616,233.07	823,837.39	-
600580	卧龙电气	2014 年 12 月 8 日	重大事项停牌	10.48	2015 年 1 月 14 日	11.12	78,519	573,972.57	822,879.12	-
600704	物产中大	2014 年 10 月 13 日	重大事项停牌	10.38	2015 年 2 月 13 日	11.42	78,832	668,505.62	818,276.16	-
600458	时代新材	2014 年 10 月 27 日	重大事项停牌	12.18	2015 年 1 月 5 日	13.40	62,312	679,924.16	758,960.16	-
002168	深圳惠程	2014 年 11 月 28 日	重大事项停牌	10.13	2015 年 1 月 28 日	9.51	72,725	604,801.10	736,704.25	-
002050	三花股份	2014 年 10 月 27 日	重大事项停牌	13.57	2015 年 1 月 27 日	14.93	51,898	567,123.55	704,255.86	-
000627	天茂集团	2014 年 10 月 22 日	重大事项停牌	4.10	2015 年 1 月 16 日	4.51	150,781	494,691.19	618,202.10	-
002396	星网锐捷	2014 年 10 月 20 日	重大事项停牌	27.31	2015 年 2 月 9 日	30.04	22,600	515,084.49	617,206.00	-
600754	锦江股份	2014 年 11 月 10 日	重大事项停牌	25.11	2015 年 1 月 19 日	27.00	22,900	419,874.28	575,019.00	-
002663	普邦园林	2014 年 12 月 9 日	重大事项停牌	14.40	2015 年 3 月 17 日	15.84	39,270	587,945.83	565,488.00	-
000501	鄂武商 A	2014 年 12 月 24 日	重大事项停牌	15.82	2015 年 1 月 16 日	17.20	33,599	416,069.74	531,536.18	-
600487	亨通光电	2014 年 10 月 30 日	重大事项停牌	18.95	2015 年 1 月 19 日	20.60	28,020	464,186.82	530,979.00	-
000506	中润资源	2014 年 11 月 4 日	重大事项停牌	6.97	2015 年 2 月 16 日	6.27	73,996	403,077.83	515,752.12	-
600844	丹化科技	2014 年 12 月 15 日	重大事项停牌	7.60	2015 年 1 月 7 日	8.25	66,218	610,399.03	503,256.80	-
002123	荣信股份	2014 年 12 月 22 日	重大事项停牌	9.22	未知	未知	53,434	478,072.97	492,661.48	-
000426	兴业矿业	2014 年 12 月 11 日	重大事项停牌	11.95	未知	未知	40,970	435,613.21	489,591.50	-
002308	威创股份	2014 年 12 月 29 日	重大事项停牌	8.25	2015 年 2 月 4 日	9.08	55,140	469,442.33	454,905.00	-
000982	中银绒业	2014 年 8 月 25 日	重大事项停牌	4.64	未知	未知	92,920	446,827.09	431,148.80	-
002482	广田股份	2014 年 12 月 10 日	重大事项停牌	15.13	2015 年 1 月 6 日	16.64	28,493	513,585.57	431,099.09	-
600575	皖江物流	2014 年 9 月 9 日	重大事项停牌	4.11	未知	未知	94,200	301,002.00	387,162.00	-
601519	大智	2014 年 7 月 21 日	重大事项	5.98	2015 年 1 月 23 日	6.58	63,869	300,388.27	381,936.62	-

	慧		停牌							
000719	大地传媒	2014 年 12 月 26 日	重大事项停牌	16.55	未知	未知	20,999	273,869.16	347,533.45	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2014 年 12 月 31 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2014 年 12 月 31 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。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。

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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人中国建设银行和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均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 12 月 31 日，本基金未持有债券投资 (2013 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.3 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对兑付申购赎回产生的退补款、现金替代款和现金差额的流动性风险，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。

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。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 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 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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和结算备付金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 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	2,540,818.65	-	-	-	2,540,818.65
结算备付金	4,431.00	-	-	-	4,431.00
存出保证金	3,782.93	-	-	-	3,782.93
交易性金融资产	-	-	-	368,819,410.29	368,819,410.29
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	57,883.98	57,883.98
应收利息	-	-	-	762.86	762.86
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-

递延所得税资产					
其他资产					
资产总计	2,549,032.58			368,878,057.13	371,427,089.71
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					
应付管理人报酬				161,362.00	161,362.00
应付托管费				32,272.41	32,272.41
应付销售服务费					
应付交易费用				80,267.63	80,267.63
应交税费					
应付利息					
应付利润					
递延所得税负债					
其他负债				628,630.64	628,630.64
负债总计				902,532.68	902,532.68
利率敏感度缺口	2,549,032.58			367,975,524.45	370,524,557.03
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	2,473,175.57				2,473,175.57
结算备付金	10,056.95				10,056.95
存出保证金	7,109.69				7,109.69
交易性金融资产				248,408,858.24	248,408,858.24
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				556.34	556.34
应收股利					
应收申购款					
递延所得税资产					
其他资产					
资产总计	2,490,342.21			248,409,414.58	250,899,756.79
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	108,396.79	108,396.79
应付托管费	-	-	-	21,679.36	21,679.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	70,922.92	70,922.92
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	411,612.80	411,612.80
负债总计	-	-	-	612,611.87	612,611.87
利率敏感度缺口	2,490,342.21	-	-	247,796,802.71	250,287,144.92

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2014 年 12 月 31 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)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(如流动性原因)导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%。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。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 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	368,819,410.29	99.54	248,408,858.24	99.25
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	368,819,410.29	99.54	248,408,858.24	99.25

## 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	18,399,223.73	-
业绩比较基准下降 5%	-18,399,223.73	-	

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。

## 7.4.13.4.4 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

## 7.4.14 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 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次的余额为 341,261,822.76 元, 属于第二层次的余额为 27,557,587.53 元, 无属于第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日: 第一层次 243,123,298.73 元, 第二层次 5,285,559.51 元, 无属于第三层次的余额)。

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

## (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

## (2) 基金申购款

于 2014 年度, 本基金申购基金份额的对价总额为 203,787,053.59 元(2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日止期间: 107,259,405.34 元), 其中包括以股票支付的申购款 194,480,570.04 元(2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日止期间: 104,336,404.14 元)和以现金支付的申购款 9,306,483.55 元(2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日止期间: 2,923,001.20 元)。

(3) 除公允价值和基金申购款外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	368,819,410.29	99.30
	其中: 股票	368,819,410.29	99.30
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-



	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,545,249.65	0.69
7	其他各项资产	62,429.77	0.02
	合计	371,427,089.71	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	6,695,941.08	1.81
B	采矿业	12,070,027.84	3.26
C	制造业	209,605,086.08	56.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,270,617.37	3.04
E	建筑业	11,228,270.52	3.03
F	批发和零售业	24,711,139.95	6.67
G	交通运输、仓储和邮政业	14,982,975.03	4.04
H	住宿和餐饮业	575,019.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,898,293.96	5.37
J	金融业	9,740,828.33	2.63
K	房地产业	29,929,060.41	8.08
L	租赁和商务服务业	5,662,968.57	1.53
M	科学研究和技术服务业	1,521,596.11	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	2,649,977.10	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,411,343.44	1.19
S	综合	3,865,389.50	1.04
	合计	368,818,534.29	99.54

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

### 8.3 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

#### 8.3.1 期末指数投资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	601099	太平洋	328,267	4,667,956.74	1.26
2	300059	东方财富	112,500	3,145,500.00	0.85
3	300168	万达信息	45,200	2,088,240.00	0.56
4	600266	北京城建	83,357	1,972,226.62	0.53
5	600169	太原重工	225,124	1,963,081.28	0.53
6	600881	亚泰集团	251,659	1,879,892.73	0.51
7	600694	大商股份	38,838	1,861,505.34	0.50
8	000998	隆平高科	92,565	1,822,604.85	0.49
9	600755	厦门国贸	154,653	1,747,578.90	0.47
10	600410	华胜天成	84,941	1,730,248.17	0.47
11	600879	航天电子	110,442	1,722,895.20	0.46
12	600820	隧道股份	208,549	1,722,614.74	0.46
13	600811	东方集团	177,171	1,683,124.50	0.45
14	000712	锦龙股份	59,453	1,617,121.60	0.44
15	600320	振华重工	220,588	1,616,910.04	0.44
16	600158	中体产业	89,583	1,586,514.93	0.43
17	601872	招商轮船	250,800	1,577,532.00	0.43
18	000012	南玻A	174,400	1,550,416.00	0.42
19	000748	长城信息	39,700	1,544,330.00	0.42
20	600645	中源协和	37,561	1,521,596.11	0.41
21	600635	大众公用	174,819	1,491,206.07	0.40
22	600187	国中水务	193,154	1,481,491.18	0.40
23	600528	中铁二局	96,953	1,459,142.65	0.39
24	600418	江淮汽车	119,486	1,443,390.88	0.39
25	600643	爱建股份	102,612	1,407,836.64	0.38
26	600895	张江高科	102,700	1,367,964.00	0.37
27	600219	南山铝业	154,100	1,366,867.00	0.37
28	600499	科达洁能	74,000	1,366,040.00	0.37
29	600601	方正科技	291,414	1,363,817.52	0.37
30	000997	新大陆	48,400	1,361,976.00	0.37
31	600312	平高电气	90,506	1,343,109.04	0.36
32	600201	金宇集团	38,038	1,334,373.04	0.36
33	600525	长园集团	114,730	1,318,247.70	0.36

34	000528	柳 工	104,535	1,315,050.30	0.35
35	000977	浪潮信息	31,900	1,313,642.00	0.35
36	600433	冠豪高新	110,700	1,306,260.00	0.35
37	601718	际华集团	204,890	1,301,051.50	0.35
38	000897	津滨发展	171,372	1,293,858.60	0.35
39	600967	北方创业	87,236	1,287,603.36	0.35
40	600759	洲际油气	129,427	1,281,327.30	0.35
41	600490	鹏欣资源	117,307	1,265,742.53	0.34
42	000511	烯碳新材	153,290	1,258,510.90	0.34
43	002405	四维图新	64,186	1,253,552.58	0.34
44	600816	安信信托	42,079	1,236,281.02	0.33
45	600522	中天科技	80,221	1,234,601.19	0.33
46	600037	歌华有线	84,868	1,229,737.32	0.33
47	601002	晋亿实业	63,093	1,224,635.13	0.33
48	600317	营口港	257,800	1,224,550.00	0.33
49	600737	中粮屯河	136,136	1,211,610.40	0.33
50	600435	北方导航	49,455	1,210,163.85	0.33
51	300253	卫宁软件	17,200	1,203,484.00	0.32
52	000661	长春高新	13,852	1,200,968.40	0.32
53	600376	首开股份	119,000	1,199,520.00	0.32
54	002266	浙富控股	141,490	1,195,590.50	0.32
55	600584	长电科技	107,004	1,190,954.52	0.32
56	600675	中华企业	173,598	1,190,882.28	0.32
57	600787	中储股份	123,470	1,190,250.80	0.32
58	600511	国药股份	38,239	1,185,026.61	0.32
59	600765	中航重机	61,907	1,179,328.35	0.32
60	600587	新华医疗	37,638	1,179,198.54	0.32
61	002183	怡 亚 通	78,553	1,167,297.58	0.32
62	600611	大众交通	96,959	1,160,599.23	0.31
63	000758	中色股份	78,400	1,151,696.00	0.31
64	000656	金科股份	73,620	1,141,110.00	0.31
65	000939	凯迪电力	100,000	1,125,000.00	0.30
66	002250	联化科技	75,983	1,124,548.40	0.30
67	002022	科华生物	52,387	1,110,604.40	0.30
68	600138	中青旅	67,340	1,108,416.40	0.30
69	300144	宋城演艺	36,800	1,108,416.00	0.30
70	002358	森源电气	31,615	1,106,525.00	0.30
71	600872	中炬高新	105,736	1,097,539.68	0.30
72	600536	中国软件	32,818	1,079,712.20	0.29

73	600125	铁龙物流	121,290	1,074,629.40	0.29
74	000540	中天城投	91,036	1,072,404.08	0.29
75	600557	康缘药业	46,369	1,070,196.52	0.29
76	600325	华发股份	86,643	1,069,174.62	0.29
77	600517	置信电气	99,282	1,056,360.48	0.29
78	300273	和佳股份	45,500	1,053,325.00	0.28
79	600654	飞乐股份	100,053	1,043,552.79	0.28
80	600685	广船国际	29,055	1,034,939.10	0.28
81	002005	德豪润达	129,855	1,029,750.15	0.28
82	002030	达安基因	51,100	1,025,577.00	0.28
83	600805	悦达投资	90,334	1,020,774.20	0.28
84	000887	中鼎股份	73,941	1,020,385.80	0.28
85	002424	贵州百灵	24,817	1,018,737.85	0.27
86	000031	中粮地产	120,335	1,018,034.10	0.27
87	000088	盐田港	103,025	1,017,887.00	0.27
88	000690	宝新能源	160,561	1,014,745.52	0.27
89	000777	中核科技	35,733	1,012,673.22	0.27
90	600175	美都能源	195,615	1,007,417.25	0.27
91	002092	中泰化学	129,272	1,001,858.00	0.27
92	002701	奥瑞金	48,917	1,001,330.99	0.27
93	000652	泰达股份	137,064	1,000,567.20	0.27
94	600200	江苏吴中	82,902	993,994.98	0.27
95	000680	山推股份	131,603	993,602.65	0.27
96	601000	唐山港	107,772	992,580.12	0.27
97	000988	华工科技	82,924	990,112.56	0.27
98	002063	远光软件	49,079	984,033.95	0.27
99	002573	国电清新	35,450	981,256.00	0.26
100	600478	科力远	50,244	970,211.64	0.26
101	600426	华鲁恒升	88,537	968,594.78	0.26
102	600259	广晟有色	17,411	967,703.38	0.26
103	000612	焦作万方	95,664	966,206.40	0.26
104	000415	渤海租赁	70,536	964,227.12	0.26
105	600110	中科英华	152,721	963,669.51	0.26
106	601001	大同煤业	111,100	963,237.00	0.26
107	002073	软控股份	78,860	954,994.60	0.26
108	000786	北新建材	37,680	952,550.40	0.26
109	600098	广州发展	108,600	951,336.00	0.26
110	600017	日照港	204,210	949,576.50	0.26
111	002340	格林美	73,448	948,948.16	0.26

112	600978	宜华木业	157,549	948,444.98	0.26
113	601666	平煤股份	156,800	945,504.00	0.26
114	000671	阳光城	68,136	945,046.32	0.26
115	600216	浙江医药	86,900	943,734.00	0.25
116	002155	辰州矿业	92,325	940,791.75	0.25
117	000616	亿城投资	196,470	937,161.90	0.25
118	300134	大富科技	25,300	936,859.00	0.25
119	600151	航天机电	99,673	935,929.47	0.25
120	600062	华润双鹤	45,500	921,830.00	0.25
121	600422	昆明制药	37,028	919,034.96	0.25
122	002271	东方雨虹	27,546	918,383.64	0.25
123	000685	中山公用	41,179	915,409.17	0.25
124	002440	闰土股份	50,977	913,507.84	0.25
125	600521	华海药业	62,575	909,840.50	0.25
126	002018	华信国际	65,000	909,350.00	0.25
127	600432	吉恩镍业	63,900	909,297.00	0.25
128	600747	大连控股	137,542	906,401.78	0.24
129	000933	神火股份	151,309	906,340.91	0.24
130	600183	生益科技	113,485	905,610.30	0.24
131	600720	祁连山	82,503	905,057.91	0.24
132	300202	聚龙股份	29,100	898,899.00	0.24
133	600067	冠城大通	110,672	896,443.20	0.24
134	600770	综艺股份	103,421	895,625.86	0.24
135	000543	皖能电力	69,710	895,076.40	0.24
136	600428	中远航运	111,852	894,816.00	0.24
137	600761	安徽合力	57,063	893,035.95	0.24
138	000422	湖北宜化	119,135	892,321.15	0.24
139	601012	隆基股份	42,718	890,243.12	0.24
140	000735	罗牛山	116,728	889,467.36	0.24
141	600056	中国医药	53,919	884,810.79	0.24
142	000006	深振业A	125,457	884,471.85	0.24
143	600161	天坛生物	34,260	884,250.60	0.24
144	002223	鱼跃医疗	35,296	880,988.16	0.24
145	002428	云南锗业	60,635	879,813.85	0.24
146	000975	银泰资源	57,524	879,541.96	0.24
147	002437	誉衡药业	36,903	876,446.25	0.24
148	000848	承德露露	39,774	874,630.26	0.24
149	000959	首钢股份	210,600	873,990.00	0.24
150	600122	宏图高科	121,685	872,481.45	0.24

151	002240	威华股份	38,900	870,971.00	0.24
152	600064	南京高科	47,960	862,800.40	0.23
153	000050	深天马 A	44,999	862,180.84	0.23
154	600284	浦东建设	73,550	854,651.00	0.23
155	000877	天山股份	81,874	839,208.50	0.23
156	002505	大康牧业	115,100	837,928.00	0.23
157	601717	郑煤机	109,771	837,552.73	0.23
158	002191	劲嘉股份	61,026	836,666.46	0.23
159	002106	莱宝高科	65,600	831,808.00	0.22
160	600639	浦东金桥	34,952	831,508.08	0.22
161	000550	江铃汽车	27,435	831,280.50	0.22
162	600240	华业地产	114,581	823,837.39	0.22
163	600580	卧龙电气	78,519	822,879.12	0.22
164	600704	物产中大	78,832	818,276.16	0.22
165	600545	新疆城建	71,646	816,047.94	0.22
166	000926	福星股份	75,598	813,434.48	0.22
167	000930	中粮生化	102,327	812,476.38	0.22
168	600572	康恩贝	53,811	812,007.99	0.22
169	000563	陕国投 A	64,569	811,632.33	0.22
170	002048	宁波华翔	56,203	807,637.11	0.22
171	002368	太极股份	18,300	803,370.00	0.22
172	600651	飞乐音响	98,186	803,161.48	0.22
173	600835	上海机电	42,775	802,459.00	0.22
174	000566	海南海药	52,660	801,485.20	0.22
175	600797	浙大网新	109,130	794,466.40	0.21
176	300147	香雪制药	47,300	788,964.00	0.21
177	600582	天地科技	64,500	786,255.00	0.21
178	600270	外运发展	48,044	785,519.40	0.21
179	600160	巨化股份	120,136	783,286.72	0.21
180	000669	金鸿能源	26,667	782,676.45	0.21
181	000028	国药一致	16,342	780,003.66	0.21
182	002004	华邦颖泰	44,799	778,606.62	0.21
183	600970	中材国际	57,918	776,680.38	0.21
184	002219	恒康医疗	40,747	776,230.35	0.21
185	000099	中信海直	56,208	772,860.00	0.21
186	600366	宁波韵升	47,767	771,437.05	0.21
187	601608	中信重工	109,121	767,120.63	0.21
188	600198	大唐电信	46,812	766,312.44	0.21
189	600026	中海发展	84,096	765,273.60	0.21

190	002299	圣农发展	60,400	764,060.00	0.21
191	002285	世联行	50,705	762,603.20	0.21
192	000078	海王生物	77,721	759,334.17	0.20
193	600458	时代新材	62,312	758,960.16	0.20
194	600409	三友化工	122,844	757,947.48	0.20
195	601369	陕鼓动力	86,936	756,343.20	0.20
196	600171	上海贝岭	71,475	755,490.75	0.20
197	000667	美好集团	238,046	754,605.82	0.20
198	600120	浙江东方	40,107	750,803.04	0.20
199	600673	东阳光科	50,444	748,588.96	0.20
200	600596	新安股份	72,018	747,546.84	0.20
201	600546	山煤国际	131,400	745,038.00	0.20
202	600825	新华传媒	69,170	740,119.00	0.20
203	600220	江苏阳光	189,550	739,245.00	0.20
204	601311	骆驼股份	56,400	737,712.00	0.20
205	002168	深圳惠程	72,725	736,704.25	0.20
206	000830	鲁西化工	136,083	734,848.20	0.20
207	600748	上实发展	57,459	730,303.89	0.20
208	000718	苏宁环球	108,500	730,205.00	0.20
209	000488	晨鸣纸业	117,775	726,671.75	0.20
210	001696	宗申动力	91,171	726,632.87	0.20
211	002122	天马股份	94,692	722,499.96	0.19
212	002179	中航光电	30,769	722,456.12	0.19
213	000513	丽珠集团	14,567	720,192.48	0.19
214	603766	隆鑫通用	53,500	719,040.00	0.19
215	600176	中国玻纤	46,331	716,740.57	0.19
216	000726	鲁泰A	59,619	714,831.81	0.19
217	600086	东方金钰	27,920	714,472.80	0.19
218	000541	佛山照明	69,891	713,587.11	0.19
219	002309	中利科技	37,872	713,129.76	0.19
220	600509	天富能源	72,026	710,896.62	0.19
221	000090	天健集团	51,437	709,830.60	0.19
222	002013	中航机电	28,480	706,304.00	0.19
223	000829	天音控股	87,862	705,531.86	0.19
224	002050	三花股份	51,898	704,255.86	0.19
225	002311	海大集团	56,717	696,484.76	0.19
226	000979	中弘股份	152,970	696,013.50	0.19
227	002508	老板电器	21,325	695,195.00	0.19
228	002273	水晶光电	40,600	694,260.00	0.19

229	002665	首航节能	17,700	692,601.00	0.19
230	000572	海马汽车	130,811	689,373.97	0.19
231	600392	盛和资源	24,800	688,200.00	0.19
232	600757	长江传媒	80,616	686,042.16	0.19
233	600823	世茂股份	46,600	685,486.00	0.19
234	600851	海欣股份	78,394	681,243.86	0.18
235	600859	王府井	30,700	680,926.00	0.18
236	000816	江淮动力	113,064	679,514.64	0.18
237	600416	湘电股份	56,383	678,851.32	0.18
238	000762	西藏矿业	50,639	678,056.21	0.18
239	600812	华北制药	108,259	670,123.21	0.18
240	600702	沱牌舍得	35,892	668,667.96	0.18
241	600004	白云机场	61,017	666,915.81	0.18
242	000636	风华高科	74,961	664,154.46	0.18
243	600021	上海电力	85,032	664,099.92	0.18
244	000788	北大医药	47,500	664,050.00	0.18
245	000732	泰禾集团	40,318	663,231.10	0.18
246	600657	信达地产	80,954	660,584.64	0.18
247	600699	均胜电子	33,850	660,413.50	0.18
248	002277	友阿股份	52,257	660,005.91	0.18
249	000900	现代投资	94,009	659,943.18	0.18
250	002317	众生药业	34,280	658,176.00	0.18
251	000697	炼石有色	37,235	656,453.05	0.18
252	600039	四川路桥	120,184	656,204.64	0.18
253	002595	豪迈科技	26,417	655,141.60	0.18
254	600261	阳光照明	77,105	653,850.40	0.18
255	300039	上海凯宝	51,100	647,948.00	0.17
256	002414	高德红外	31,878	647,123.40	0.17
257	600864	哈投股份	43,452	645,262.20	0.17
258	002431	棕榈园林	30,500	643,855.00	0.17
259	600141	兴发集团	42,200	643,128.00	0.17
260	600351	亚宝药业	73,417	640,930.41	0.17
261	002690	美亚光电	17,988	640,372.80	0.17
262	601678	滨化股份	61,348	637,405.72	0.17
263	000961	中南建设	46,500	637,050.00	0.17
264	600874	创业环保	57,642	636,944.10	0.17
265	002161	远望谷	78,592	636,595.20	0.17
266	600884	杉杉股份	38,322	635,761.98	0.17
267	000973	佛塑科技	102,581	633,950.58	0.17



268	600006	东风汽车	106,152	631,604.40	0.17
269	300088	长信科技	40,800	631,176.00	0.17
270	000969	安泰科技	68,835	627,775.20	0.17
271	600993	马应龙	30,744	623,488.32	0.17
272	300115	长盈精密	34,300	621,859.00	0.17
273	000627	天茂集团	150,781	618,202.10	0.17
274	002396	星网锐捷	22,600	617,206.00	0.17
275	601880	大连港	133,808	616,854.88	0.17
276	002204	大连重工	51,373	615,962.27	0.17
277	002672	东江环保	17,705	615,071.70	0.17
278	600073	上海梅林	65,429	613,724.02	0.17
279	600790	轻纺城	74,731	613,541.51	0.17
280	002028	思源电气	49,071	610,933.95	0.16
281	000650	仁和药业	78,903	609,131.16	0.16
282	002221	东华能源	36,836	607,425.64	0.16
283	002371	七星电子	23,200	605,520.00	0.16
284	600112	天成控股	53,914	604,915.08	0.16
285	600199	金种子酒	51,735	603,747.45	0.16
286	002444	巨星科技	53,710	601,552.00	0.16
287	002041	登海种业	18,711	599,687.55	0.16
288	000417	合肥百货	72,336	599,665.44	0.16
289	002056	横店东磁	27,200	597,040.00	0.16
290	600289	亿阳信通	60,202	595,999.80	0.16
291	000931	中关村	71,539	595,919.87	0.16
292	002064	华峰氨纶	55,535	594,224.50	0.16
293	002181	粤传媒	38,661	593,832.96	0.16
294	002588	史丹利	15,170	590,871.50	0.16
295	600380	健康元	82,157	590,708.83	0.16
296	600997	开滦股份	82,054	589,968.26	0.16
297	600628	新世界	56,367	589,598.82	0.16
298	002237	恒邦股份	36,346	589,168.66	0.16
299	600894	广日股份	45,630	586,345.50	0.16
300	600971	恒源煤电	66,453	580,134.69	0.16
301	002052	同洲电子	63,500	579,120.00	0.16
302	002325	洪涛股份	53,351	578,858.35	0.16
303	000850	华茂股份	75,107	576,070.69	0.16
304	600059	古越龙山	64,434	576,039.96	0.16
305	002244	滨江集团	71,635	575,945.40	0.16
306	600754	锦江股份	22,900	575,019.00	0.16

307	000587	金叶珠宝	51,836	572,269.44	0.15
308	600251	冠农股份	31,222	570,113.72	0.15
309	600460	士兰微	99,429	567,739.59	0.15
310	002269	美邦服饰	53,800	567,590.00	0.15
311	600300	维维股份	111,000	566,100.00	0.15
312	002663	普邦园林	39,270	565,488.00	0.15
313	000860	顺鑫农业	30,247	565,013.96	0.15
314	000596	古井贡酒	15,200	561,640.00	0.15
315	000021	长城开发	78,156	561,160.08	0.15
316	000681	视觉中国	26,600	558,068.00	0.15
317	002251	步步高	39,517	553,633.17	0.15
318	600740	山西焦化	81,378	546,860.16	0.15
319	601101	昊华能源	63,500	546,100.00	0.15
320	002477	雏鹰农牧	62,327	545,984.52	0.15
321	002011	盾安环境	55,807	545,792.46	0.15
322	600826	兰生股份	27,799	544,582.41	0.15
323	600612	老凤祥	16,843	544,534.19	0.15
324	600481	双良节能	53,920	544,052.80	0.15
325	000919	金陵药业	39,958	543,428.80	0.15
326	002203	海亮股份	61,583	542,546.23	0.15
327	600482	风帆股份	42,656	542,157.76	0.15
328	002254	泰和新材	47,323	541,375.12	0.15
329	600729	重庆百货	21,646	540,933.54	0.15
330	600586	金晶科技	132,085	537,585.95	0.15
331	002390	信邦制药	26,500	535,830.00	0.14
332	002029	七匹狼	60,097	535,464.27	0.14
333	002463	沪电股份	111,228	532,782.12	0.14
334	002140	东华科技	29,569	531,946.31	0.14
335	000501	鄂武商 A	33,599	531,536.18	0.14
336	600487	亨通光电	28,020	530,979.00	0.14
337	600292	中电远达	23,743	528,994.04	0.14
338	600885	宏发股份	28,200	526,776.00	0.14
339	000809	铁岭新城	51,136	524,655.36	0.14
340	600239	云南城投	76,465	523,785.25	0.14
341	600387	海越股份	40,914	523,290.06	0.14
342	600132	重庆啤酒	32,100	519,378.00	0.14
343	002332	仙琚制药	47,617	519,025.30	0.14
344	600563	法拉电子	17,970	517,895.40	0.14
345	600496	精工钢构	54,527	517,461.23	0.14

346	000506	中润资源	73,996	515,752.12	0.14
347	002276	万马股份	62,351	513,148.73	0.14
348	000886	海南高速	104,938	513,146.82	0.14
349	002646	青青稞酒	23,717	508,729.65	0.14
350	601886	江河创建	61,217	508,101.10	0.14
351	600425	青松建化	73,108	503,714.12	0.14
352	600844	丹化科技	66,218	503,256.80	0.14
353	600438	通威股份	54,097	503,102.10	0.14
354	000066	长城电脑	87,735	502,721.55	0.14
355	002025	航天电器	26,135	493,951.50	0.13
356	002123	荣信股份	53,434	492,661.48	0.13
357	600337	美克家居	51,631	492,559.74	0.13
358	000049	德赛电池	16,302	491,016.24	0.13
359	000426	兴业矿业	40,970	489,591.50	0.13
360	600456	宝钛股份	28,470	489,114.60	0.13
361	002551	尚荣医疗	23,910	488,242.20	0.13
362	600736	苏州高新	84,388	486,918.76	0.13
363	002408	齐翔腾达	29,714	485,526.76	0.13
364	600260	凯乐科技	55,863	482,656.32	0.13
365	002233	塔牌集团	47,451	482,576.67	0.13
366	002480	新筑股份	42,699	482,498.70	0.13
367	600636	三爱富	35,565	482,261.40	0.13
368	600298	安琪酵母	26,117	482,119.82	0.13
369	600750	江中药业	23,703	479,985.75	0.13
370	600831	广电网络	52,446	478,831.98	0.13
371	002345	潮宏基	55,957	470,038.80	0.13
372	000620	新华联	63,627	468,930.99	0.13
373	600773	西藏城投	38,584	467,252.24	0.13
374	000823	超声电子	42,717	466,469.64	0.13
375	002342	巨力索具	76,455	466,375.50	0.13
376	000951	中国重汽	22,332	461,825.76	0.12
377	002308	威创股份	55,140	454,905.00	0.12
378	600850	华东电脑	12,700	452,628.00	0.12
379	600488	天药股份	76,509	451,403.10	0.12
380	002069	獐子岛	37,900	451,010.00	0.12
381	002242	九阳股份	40,617	449,630.19	0.12
382	000852	江钻股份	21,381	445,580.04	0.12
383	600335	国机汽车	24,800	444,664.00	0.12
384	002384	东山精密	40,617	444,349.98	0.12

385	000510	金路集团	80,954	443,627.92	0.12
386	600537	亿晶光电	32,200	441,462.00	0.12
387	600640	号百控股	28,300	436,952.00	0.12
388	600329	中新药业	28,564	435,886.64	0.12
389	000555	神州信息	11,300	435,050.00	0.12
390	600401	海润光伏	62,717	433,374.47	0.12
391	600551	时代出版	26,717	433,082.57	0.12
392	600180	瑞茂通	35,045	431,754.40	0.12
393	002489	浙江永强	31,757	431,577.63	0.12
394	000982	中银绒业	92,920	431,148.80	0.12
395	002482	广田股份	28,493	431,099.09	0.12
396	600830	香溢融通	42,087	429,708.27	0.12
397	002275	桂林三金	23,371	428,857.85	0.12
398	002392	北京利尔	31,800	427,392.00	0.12
399	000525	红太阳	26,811	425,490.57	0.11
400	000030	富奥股份	50,149	423,759.05	0.11
401	600614	鼎立股份	31,739	422,128.70	0.11
402	000927	一汽夏利	63,543	420,019.23	0.11
403	002727	一心堂	10,200	419,322.00	0.11
404	600439	瑞贝卡	87,536	418,422.08	0.11
405	002083	孚日股份	84,454	416,358.22	0.11
406	002216	三全食品	21,444	416,228.04	0.11
407	002315	焦点科技	7,587	415,767.60	0.11
408	002714	牧原股份	9,443	415,492.00	0.11
409	600429	三元股份	47,000	415,010.00	0.11
410	000703	恒逸石化	45,900	414,477.00	0.11
411	002091	江苏国泰	28,588	413,668.36	0.11
412	600776	东方通信	50,834	413,280.42	0.11
413	002118	紫鑫药业	34,100	410,223.00	0.11
414	600780	通宝能源	60,840	410,061.60	0.11
415	000962	东方钽业	35,191	409,623.24	0.11
416	601233	桐昆股份	38,508	408,184.80	0.11
417	002503	搜于特	20,660	407,415.20	0.11
418	002128	露天煤业	43,336	404,324.88	0.11
419	000062	深圳华强	26,400	400,488.00	0.11
420	601801	皖新传媒	24,018	399,179.16	0.11
421	000921	海信科龙	47,700	398,295.00	0.11
422	002281	光迅科技	10,641	395,419.56	0.11
423	600088	中视传媒	22,104	391,019.76	0.11

424	000519	江南红箭	29,300	390,276.00	0.11
425	002698	博实股份	15,900	389,550.00	0.11
426	603077	和邦股份	40,077	388,746.90	0.10
427	002249	大洋电机	33,902	388,516.92	0.10
428	002648	卫星石化	32,062	387,950.20	0.10
429	600575	皖江物流	94,200	387,162.00	0.10
430	601908	京运通	34,295	385,818.75	0.10
431	002393	力生制药	12,028	385,256.84	0.10
432	600616	金枫酒业	40,818	382,872.84	0.10
433	000418	小天鹅 A	29,249	382,576.92	0.10
434	002293	罗莱家纺	14,848	382,484.48	0.10
435	601519	大智慧	63,869	381,936.62	0.10
436	000861	海印股份	47,100	378,213.00	0.10
437	601126	四方股份	21,713	375,634.90	0.10
438	600983	惠而浦	30,474	374,830.20	0.10
439	603005	晶方科技	8,900	374,690.00	0.10
440	600507	方大特钢	70,300	372,590.00	0.10
441	002078	太阳纸业	91,507	371,518.42	0.10
442	600467	好当家	58,130	369,706.80	0.10
443	603369	今世缘	13,200	367,884.00	0.10
444	600195	中牧股份	22,898	362,933.30	0.10
445	600078	澄星股份	52,835	360,863.05	0.10
446	002574	明牌珠宝	35,055	358,963.20	0.10
447	600197	伊力特	29,166	358,158.48	0.10
448	601777	力帆股份	39,976	354,187.36	0.10
449	002479	富春环保	38,883	353,057.64	0.10
450	000693	华泽钴镍	14,400	348,624.00	0.09
451	002093	国脉科技	57,300	348,384.00	0.09
452	600389	江山股份	13,100	348,198.00	0.09
453	601208	东材科技	40,700	347,985.00	0.09
454	000719	大地传媒	20,999	347,533.45	0.09
455	002461	珠江啤酒	27,118	347,381.58	0.09
456	603366	日出东方	21,280	345,374.40	0.09
457	002174	游族网络	7,100	343,001.00	0.09
458	002557	洽洽食品	18,000	340,380.00	0.09
459	600743	华远地产	72,280	333,933.60	0.09
460	002678	珠江钢琴	25,217	333,116.57	0.09
461	002226	江南化工	26,361	331,621.38	0.09
462	600280	中央商场	23,017	331,444.80	0.09

463	000780	平庄能源	53,936	330,627.68	0.09
464	600162	香江控股	51,053	329,802.38	0.09
465	601515	东风股份	29,440	329,139.20	0.09
466	000688	建新矿业	45,200	326,796.00	0.09
467	600510	黑牡丹	42,115	324,706.65	0.09
468	002267	陕天然气	29,450	318,354.50	0.09
469	600803	威远生化	26,017	317,147.23	0.09
470	600468	百利电气	23,851	316,741.28	0.09
471	002194	武汉凡谷	29,494	315,585.80	0.09
472	601965	中国汽研	25,417	311,104.08	0.08
473	601999	出版传媒	29,166	305,951.34	0.08
474	002327	富安娜	22,750	304,850.00	0.08
475	603328	依顿电子	12,900	300,441.00	0.08
476	600618	氯碱化工	29,846	296,967.70	0.08
477	601566	九牧王	23,017	296,919.30	0.08
478	601010	文峰股份	29,408	295,550.40	0.08
479	002419	天虹商场	21,481	291,926.79	0.08
480	600184	光电股份	8,125	291,200.00	0.08
481	002430	杭氧股份	33,180	290,656.80	0.08
482	002225	濮耐股份	41,999	290,213.09	0.08
483	000552	靖远煤电	28,500	287,850.00	0.08
484	603001	奥康国际	15,945	284,777.70	0.08
485	600397	安源煤业	52,655	284,337.00	0.08
486	603555	贵人鸟	16,300	273,188.00	0.07
487	600801	华新水泥	25,656	271,697.04	0.07
488	600333	长春燃气	35,170	270,457.30	0.07
489	601388	怡球资源	28,201	262,269.30	0.07
490	000631	顺发恒业	41,498	261,022.42	0.07
491	002635	安洁科技	9,498	256,161.06	0.07
492	002490	山东墨龙	28,670	247,422.10	0.07
493	002320	海峡股份	22,717	246,025.11	0.07
494	002662	京威股份	19,935	241,213.50	0.07
495	002498	汉缆股份	28,373	231,807.41	0.06
496	600869	智慧能源	26,138	230,537.16	0.06
497	002238	天威视讯	15,674	219,749.48	0.06
498	601011	宝泰隆	20,595	204,302.40	0.06
499	002612	朗姿股份	7,799	179,377.00	0.05
500	002705	新宝股份	11,600	170,984.00	0.05
501	000603	盛达矿业	13,349	163,658.74	0.04

注：上海证券交易所、中证指数有限公司发布 2014 年 12 月 15 日生效的中证 500 指数样本股调整，天茂集团(000627)被调出成份股，该股于 2014 年 10 月 22 日至 2015 年 1 月 15 日停牌，2015 年 1 月份复牌后卖出。

### 8.3.2 期末积极投资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

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	300059	东方财富	3,297,229.84	1.32
2	300168	万达信息	1,709,240.17	0.68
3	000012	南玻 A	1,534,691.37	0.61
4	600317	营口港	1,423,600.58	0.57
5	600499	科达洁能	1,417,036.00	0.57
6	000748	长城信息	1,381,048.00	0.55
7	600433	冠豪高新	1,329,139.82	0.53
8	600219	南山铝业	1,281,723.00	0.51
9	601099	太平洋	1,259,301.00	0.50
10	000661	长春高新	1,208,827.18	0.48
11	002266	浙富控股	1,195,539.86	0.48
12	002030	达安基因	1,180,809.78	0.47
13	300253	卫宁软件	1,158,052.74	0.46
14	600895	张江高科	1,148,460.38	0.46
15	601872	招商轮船	1,140,758.30	0.46
16	300273	和佳股份	1,092,010.00	0.44
17	000758	中色股份	1,078,928.08	0.43
18	600201	金宇集团	1,075,363.11	0.43
19	300134	大富科技	1,049,500.13	0.42
20	300144	宋城演艺	1,037,508.42	0.41

### 8.4.2 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	600570	恒生电子	4,200,977.45	1.68
2	000559	万向钱潮	2,118,905.25	0.85
3	002153	石基信息	1,397,997.80	0.56
4	002252	上海莱士	1,385,254.67	0.55
5	002008	大族激光	1,384,736.98	0.55
6	600398	海澜之家	1,334,650.84	0.53
7	002152	广电运通	1,264,768.93	0.51
8	600594	益佰制药	1,207,043.59	0.48
9	601929	吉视传媒	1,170,222.75	0.47
10	002465	海格通信	1,148,649.23	0.46
11	600499	科达洁能	1,117,807.09	0.45
12	600500	中化国际	1,107,525.87	0.44
13	600038	哈飞股份	1,073,116.67	0.43
14	002049	同方国芯	1,065,527.90	0.43
15	002400	省广股份	1,065,140.92	0.43
16	600503	华丽家族	1,025,899.52	0.41
17	600388	龙净环保	955,301.69	0.38
18	002190	成飞集成	899,480.90	0.36
19	600880	博瑞传播	894,843.65	0.36
20	000518	四环生物	867,023.98	0.35

#### 8.4.3 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	96,546,106.01
卖出股票收入（成交）总额	87,154,260.52

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。



**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

**8.11 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。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1**

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。

**8.12.2**

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。

**8.12.3 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	3,782.93
2	应收证券清算款	57,883.98
3	应收股利	-
4	应收利息	762.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	62,429.77

**8.12.4 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。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****8.12.5.1 期末指数投资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	300168	万达信息	2,088,240.00	0.56	重大事项停牌

### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 本基金的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
1,687	41,334.84	52,910,459.00	75.88%	16,821,409.00	24.12%

#### 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例
嘉实中证 500ETF 联接	46,260,132.00	66.34%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份 额比例
1	南宁市宁泰资产管理有限公司	3,655,190.00	5.24%
2	中信证券股份有限公司	1,206,450.00	1.73%
3	天津珍熙美容实业有限公司	1,039,505.00	1.49%
4	杨碧茹	411,424.00	0.59%
5	杨锦华	307,970.00	0.44%
6	徐隽	280,402.00	0.40%
7	马玉敏	280,399.00	0.40%
8	上海龙苍投资有限公司	238,268.00	0.34%
9	周爱芬	217,201.00	0.31%
10	段富云	196,285.00	0.28%
	中国建设银行股份有限公司—嘉实 中证 500 交易型开放式指数证券投 资基金联接基金	46,260,132.00	66.34%

**9.3 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	-	-

**9.4 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**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2013年2月6日）基金份额总额	3,108,729,402.00
本报告期期初基金份额总额	65,231,868.00
本报告期基金总申购份额	43,650,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	39,150,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	69,731,868.00

**§ 11 重大事件揭示****11.1 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。

**11.2 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10月10日本基金管理人发布公告，聘请邵健先生、李松林先生担任公司副总经理职务。

2014年12月10日本基金管理人发布公告，安奎先生因任期届满不再担任公司董事长，邓红国先生任公司董事长。

**(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。

本基金托管人 2014 年 11 月 03 日发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

**11.3 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。

**11.4 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。

**11.5 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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 60,000.00 元，该审计机构已连续 2 年提供审计服务。

**11.6 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。

**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****11.7.1 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	
招商证券股份有限公司	1	67,680,171.97	36.91%	47,801.86	37.04%	-
海通证券股份有限公司	1	54,286,566.97	29.61%	38,000.53	29.45%	-
广发证券股份有限公司	1	35,241,389.48	19.22%	24,921.17	19.31%	-
中信建投证券股份有限公司	2	24,845,814.42	13.55%	17,400.62	13.48%	-
中信证券股份有限公司	1	814,050.05	0.44%	569.88	0.44%	-
申银万国证券股份有限公司	2	492,462.64	0.27%	344.80	0.27%	-
财富证券有限责任公司	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	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	155,364.00	100.00%

### 11.8 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嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2014 年 2 月 20 日
2	嘉实基金管理有限公司关于增加新时代证券股份有限公司为嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF 申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2014 年 7 月 10 日
3	嘉实基金管理有限公司关于增加方正证券股份有限公司为嘉实沪深	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人	2014 年 10 月 27 日

	300ETF、嘉实中证 500ETF 申购赎回代理券商的公告	网站	
--	--------------------------------	----	--

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (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公告的各项原稿。

### 12.2 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

### 12.3 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**  
2015 年 3 月 31 日