

嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2015 年半年度报告摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	嘉实中创 400ETF 联接
基金主代码	070030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 3 月 22 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	82,812,167.83 份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中创 400 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159918
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 3 月 22 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 11 日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪；将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。
业绩比较基准	中创 400 指数收益率*95% + 银行活期存款税后利率*5%
风险收益特征	本基金为中创 400ETF 的联接基金，主要通过投资于中创 400ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中创 400 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	蒋松云
	联系电话	(010) 65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010) 65182266	(010)66105798

2.4 信息披露方式

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

§ 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	30,777,774.81
本期利润	51,176,381.46
加权平均基金份额本期利润	0.7412
本期加权平均净值利润率	31.13%

本期基金份额净值增长率	79.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	72,065,484.27
期末可供分配基金份额利润	0.8702
期末基金资产净值	226,195,796.54
期末基金份额净值	2.7314
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	173.14%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-15.52%	3.69%	-14.32%	3.61%	-1.20%	0.08%
过去三个月	23.30%	2.93%	25.39%	2.92%	-2.09%	0.01%
过去六个月	79.80%	2.29%	85.31%	2.29%	-5.51%	0.00%
过去一年	103.00%	1.84%	111.53%	1.85%	-8.53%	-0.01%
过去三年	179.94%	1.60%	196.59%	1.62%	-16.65%	-0.02%
自基金合同生效起至今	173.14%	1.54%	174.22%	1.59%	-1.08%	-0.05%

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

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

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

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

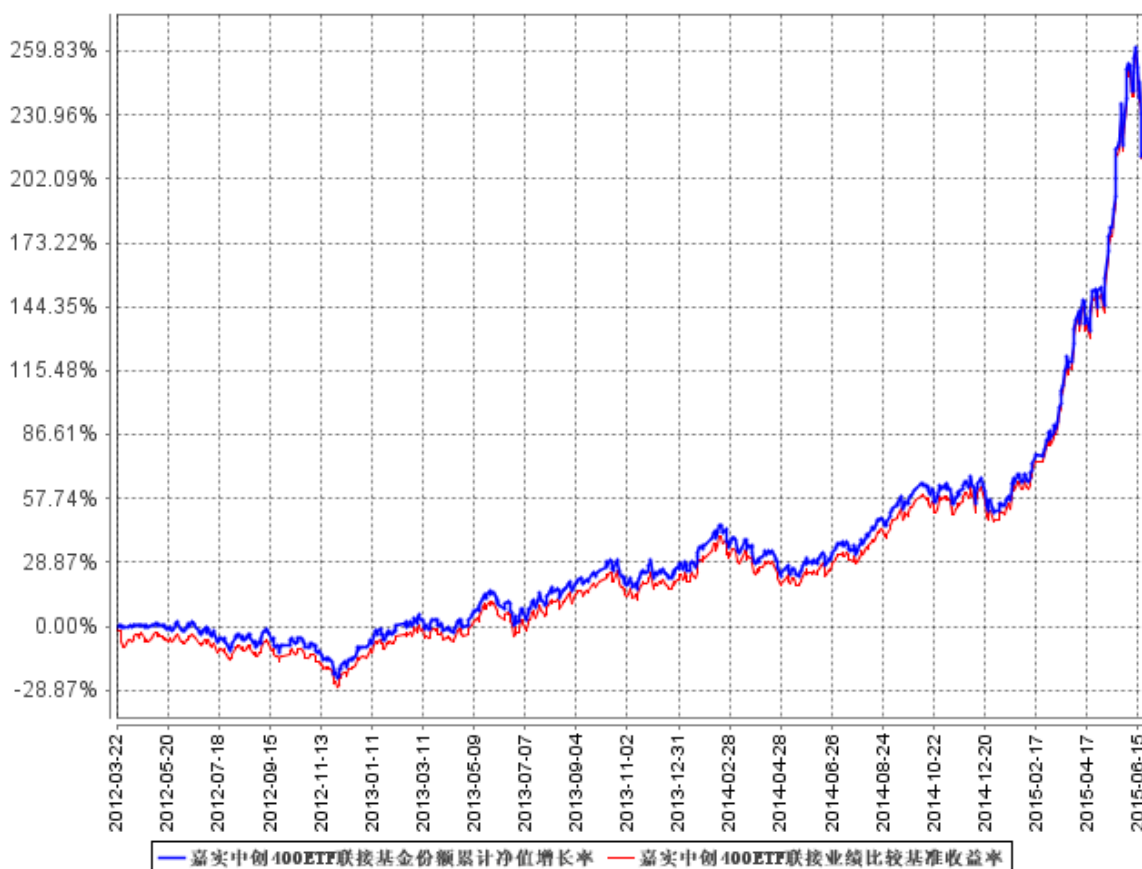
$$\text{Return}(t) = 95\% \times \text{中创 400 指数收益率}(t) + 5\% \times \text{银行活期存款税后利率}$$

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

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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

嘉实中创400ETF联接基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图：嘉实中创 400ETF 联接基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 3 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十一部分二、投资范围和六、投资限制（一）投资组合限制”的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，

在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2015 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、73 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、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 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、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、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何如	本基金、嘉实中创 400ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生	2014 年 5 月 9 日	-	9 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理

	生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 基金经理				部、指数投资部，现任公司指数投资部基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，加拿大籍。
--	-------------------------	--	--	--	--

注：（1）任职日期是指公司作出决定后公告之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，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，均为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，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

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.08%，年度化拟合偏离度为 1.31%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.35% 的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.7314 元；本报告期基金份额净值增长率为 79.80%，业

绩比较基准收益率为 85.31%。

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，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同（十五（三）基金收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损

害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2015 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	19,883,055.38	7,620,273.91
结算备付金		1,427,122.29	284,561.01
存出保证金		43,263.84	21,801.70
交易性金融资产	6.4.7.2	214,678,722.75	113,307,563.43
其中：股票投资		3,996,952.21	3,045,854.91
基金投资		210,681,770.54	110,261,708.52
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		17,213,261.67	1,183,102.45
应收利息	6.4.7.5	3,604.55	1,787.79
应收股利		-	-
应收申购款		2,897,420.40	952,522.57

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	14,330.30	89,788.51
资产总计		256,160,781.18	123,461,401.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		29,369,969.83	2,901,619.48
应付管理人报酬		12,269.54	5,823.82
应付托管费		2,453.92	1,164.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	190,472.77	92,103.70
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债	6.4.7.8	-	-
其他负债		389,818.58	360,485.09
负债合计		29,964,984.64	3,361,196.84
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	82,812,167.83	79,057,725.07
未分配利润	6.4.7.10	143,383,628.71	41,042,479.46
所有者权益合计		226,195,796.54	120,100,204.53
负债和所有者权益总计		256,160,781.18	123,461,401.37

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.7314 元，基金份额总额 82,812,167.83 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
一、收入		51,772,487.08	4,579,364.24
1.利息收入		42,403.30	27,834.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	42,403.30	27,834.32
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		30,935,785.31	1,107,466.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-305,623.86	696,088.57
基金投资收益	6.4.7.13	31,227,380.07	395,958.36
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	14,029.10	15,419.59
3.公允价值变动收益	6.4.7.17	20,398,606.65	3,375,298.42
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.18	395,691.82	68,764.98
减：二、费用		596,105.62	272,691.26
1. 管理人报酬		35,758.76	24,699.37
2. 托管费		7,151.73	4,939.83
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	376,740.07	68,181.87
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	176,455.06	174,870.19
三、利润总额		51,176,381.46	4,306,672.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润		51,176,381.46	4,306,672.98

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	79,057,725.07	41,042,479.46	120,100,204.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	51,176,381.46	51,176,381.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	3,754,442.76	51,164,767.79	54,919,210.55
其中：1. 基金申购款	144,647,377.33	259,833,221.47	404,480,598.80
2. 基金赎回款	-140,892,934.57	-208,668,453.68	-349,561,388.25

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）	82,812,167.83	143,383,628.71	226,195,796.54
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	69,013,005.85	18,063,277.15	87,076,283.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,306,672.98	4,306,672.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	29,124,032.60	11,535,765.70	40,659,798.30
其中：1. 基金申购款	76,071,155.20	27,161,189.75	103,232,344.95
2. 基金赎回款	-46,947,122.60	-15,625,424.05	-62,572,546.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	98,137,038.45	33,905,715.83	132,042,754.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 赵学军 王红 常旭
 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 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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（中国工商银行）	基金托管人、基金代销机构
中创 400 交易型开放式指数证券投资基金（嘉实中创 400ETF）	本基金是该基金的联接基金

6.4.4 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。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	35,758.76	24,699.37
其中：支付销售机构的客户维护费	88,497.94	61,779.22

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,151.73	4,939.83

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = (前一日的基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值) (若为负数，则取 0) × 0.1% / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

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（2015 年 6 月 30 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 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	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	19,883,055.38	37,707.41	7,354,586.74	26,084.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 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。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

报告期末（2015 年 6 月 30 日），本基金持有 72,721,608 份目标 ETF 基金份额（2014 年 12 月 31 日：70,653,408 份），占其总份额的比例为 92.57%（2014 年 12 月 31 日：92.28%）。

6.4.5 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.5.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300147	香雪制药	2015 年 6 月 18 日	2015 年 7 月 2 日	配股未上市	10.46	30.80	1,590	16,631.40	48,972.00	-

6.4.5.1.2 受限证券类别：债券

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金未持有流通受限的债券。

6.4.5.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金未持有流通受限的其他证券。

6.4.5.2 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
002012	凯恩股份	2015 年 5 月 28 日	重大事项停牌	14.00	2015 年 7 月 1 日	12.60	800	9,656.20	11,200.00	-
002018	华信国际	2015 年 6 月 15 日	重大事项停牌	44.08	-	-	100	3,882.44	4,408.00	-
002020	京新药业	2015 年 4 月 16 日	重大事项停牌	29.44	2015 年 8 月 10 日	26.10	300	7,943.24	8,832.00	-
002080	中材	2015 年	重大	22.79	-	-	700	16,046.44	15,953.00	-

	科技	4月21日	事项停牌								
002097	山河智能	2015年5月21日	重大事项停牌	19.80	-	-	500	9,733.71	9,900.00	-	
002166	莱茵生物	2015年5月25日	重大事项停牌	40.49		2015年7月2日	36.44	200	7,728.52	8,098.00	-
002170	芭田股份	2015年5月26日	重大事项停牌	22.78		2015年7月28日	23.51	900	22,077.61	20,502.00	-
002194	武汉凡谷	2015年6月18日	重大事项停牌	26.98		2015年7月24日	24.28	600	15,685.70	16,188.00	-
002203	海亮股份	2015年4月27日	重大事项停牌	12.71	-			700	7,878.37	8,897.00	-
002214	大立科技	2015年6月15日	重大事项停牌	20.90	-			200	4,064.54	4,180.00	-
002239	金飞达	2015年5月25日	重大事项停牌	18.33	-			200	3,511.64	3,666.00	-
002242	九阳股份	2015年6月15日	重大事项停牌	19.45		2015年7月7日	17.51	300	5,675.20	5,835.00	-
002268	卫士通	2015年5月8日	重大事项停牌	80.14		2015年8月4日	76.31	686	57,055.08	54,976.04	-
002269	美邦服饰	2015年5月22日	重大事项停牌	11.86		2015年7月2日	10.67	650	6,595.25	7,709.00	-
002276	万马股份	2015年6月30日	重大事项停牌	34.15		2015年7月20日	30.74	3,700	128,727.07	126,355.00	-
002278	神开股份	2015年5月26日	重大事项停牌	16.09	-			490	7,186.33	7,884.10	-
002288	超华科技	2015年6月8日	重大事项停牌	17.75		2015年8月17日	15.98	900	14,465.55	15,975.00	-
002296	辉煌科技	2015年6月30日	重大事项停牌	21.12		2015年8月24日	18.98	2,400	54,919.64	50,688.00	-

002298	鑫龙 电器	2015年 6月25 日	重大 事项 停牌	24.86	2015年 7月2 日	25.34	1,300	39,935.60	32,318.00	-
002303	美盈 森	2015年 6月9 日	重大 事项 停牌	37.78	2015年 7月13 日	21.43	800	39,398.29	30,224.00	-
002308	威创 股份	2015年 6月12 日	重大 事项 停牌	31.00	-	-	900	23,799.43	27,900.00	-
002309	中利 科技	2015年 6月2 日	重大 事项 停牌	33.39	2015年 7月21 日	30.05	100	3,193.39	3,339.00	-
002316	键桥 通讯	2015年 2月17 日	重大 事项 停牌	11.01	-	-	200	1,947.67	2,202.00	-
002345	潮宏 基	2015年 5月22 日	重大 事项 停牌	19.58	-	-	600	10,707.77	11,748.00	-
002367	康力 电梯	2015年 6月2 日	重大 事项 停牌	28.49	-	-	500	12,253.94	14,245.00	-
002368	太极 股份	2015年 5月14 日	重大 事项 停牌	65.52	-	-	450	28,933.10	29,484.00	-
002414	高德 红外	2015年 5月13 日	重大 事项 停牌	39.36	-	-	200	7,359.14	7,872.00	-
002416	爱施 德	2015年 5月5 日	重大 事项 停牌	20.67	2015年 7月29 日	18.60	300	6,055.71	6,201.00	-
002443	金洲 管道	2015年 5月18 日	重大 事项 停牌	15.85	2015年 7月13 日	14.27	300	4,784.63	4,755.00	-
002461	珠江 啤酒	2015年 6月4 日	重大 事项 停牌	26.40	2015年 7月24 日	23.76	1,500	36,861.43	39,600.00	-
002527	新时 达	2015年 6月15 日	重大 事项 停牌	30.92	-	-	800	23,767.55	24,736.00	-
002571	德力 股份	2015年 5月4 日	重大 事项 停牌	18.46	-	-	1,200	20,426.85	22,152.00	-
002574	明牌 珠宝	2015年 6月4 日	重大 事项	22.90	-	-	1,000	20,305.22	22,900.00	-

		日	停牌							
002577	雷柏科技	2015年 6月10 日	重大 事项 停牌	80.60	-	-	400	33,007.24	32,240.00	-
002581	万昌科技	2015年 6月18 日	重大 事项 停牌	132.01	2015年 7月1 日	118.81	300	38,719.88	39,603.00	-
002605	姚记扑克	2015年 6月16 日	重大 事项 停牌	29.01	-	-	100	2,738.36	2,901.00	-
002617	露笑科技	2015年 6月22 日	重大 事项 停牌	53.28	2015年 7月2 日	47.95	200	11,656.27	10,656.00	-
002655	共达电声	2015年 5月11 日	重大 事项 停牌	15.49	-	-	600	8,975.55	9,294.00	-
002665	首航节能	2015年 6月30 日	重大 事项 停牌	27.70	2015年 7月1 日	30.00	3,100	89,485.99	85,870.00	-
002683	宏大爆破	2015年 5月11 日	重大 事项 停牌	35.48	-	-	400	14,056.84	14,192.00	-
002716	金贵银业	2015年 4月20 日	重大 事项 停牌	13.87	2015年 8月24 日	12.48	660	9,414.00	9,154.20	-
300012	华测检测	2015年 6月15 日	重大 事项 停牌	30.80	2015年 7月27 日	38.76	600	24,707.75	18,480.00	-
300028	金亚科技	2015年 6月10 日	重大 事项 停牌	34.51	-	-	1,040	44,049.50	35,890.40	-
300071	华谊嘉信	2015年 5月21 日	重大 事项 停牌	13.66	-	-	540	7,431.18	7,376.40	-
300074	华平股份	2015年 6月29 日	重大 事项 停牌	15.39	2015年 7月14 日	16.00	1,880	33,822.00	28,933.20	-
300093	金刚玻璃	2015年 5月19 日	重大 事项 停牌	25.86	-	-	100	2,158.00	2,586.00	-
300096	易联众	2015年 5月28 日	重大 事项 停牌	39.55	-	-	600	21,765.88	23,730.00	-
300113	顺网	2015年	重大	53.60	2015年	51.93	500	28,882.26	26,800.00	-

	科技	5月5日	事项停牌		8月6日							
300135	宝利国际	2015年6月29日	重大事项停牌	12.65	-	-	6,400	83,268.15	80,960.00	-		
300142	沃森生物	2015年6月15日	重大事项停牌	37.63	-	-	600	25,136.28	22,578.00	-		
300144	宋城演艺	2015年6月18日	重大事项停牌	56.66		2015年7月20日	68.82	1,000	80,087.54	56,660.00	-	
300197	铁汉生态	2015年6月16日	重大事项停牌	36.03	-	-	500	16,882.45	18,015.00	-		
300203	聚光科技	2015年4月20日	重大事项停牌	41.19		2015年8月12日	33.88	1,000	35,856.83	41,190.00	-	
300212	易华录	2015年6月30日	重大事项停牌	59.94		2015年7月13日	54.00	2,238	144,676.23	134,145.72	-	
300215	电科院	2015年6月16日	重大事项停牌	15.62		2015年7月28日	14.06	400	6,260.64	6,248.00	-	
300228	富瑞特装	2015年6月24日	重大事项停牌	79.76		2015年7月30日	81.82	400	40,512.63	31,904.00	-	
300269	联建光电	2015年6月30日	重大事项停牌	28.81	-	-	-	1,600	48,103.13	46,096.00	-	
300287	飞利信	2015年6月2日	重大事项停牌	38.08	-	-	-	300	14,899.20	11,424.00	-	
300291	华录百纳	2015年6月30日	重大事项停牌	37.76		2015年7月13日	34.65	2,400	94,311.25	90,624.00	-	
300297	蓝盾股份	2015年4月30日	重大事项停牌	31.99		2015年7月20日	33.00	440	13,243.83	14,075.60	-	
300316	晶盛机电	2015年6月24日	重大事项停牌	25.90	-	-	-	1,160	25,719.77	30,044.00	-	
300323	华灿光电	2015年4月29日	重大事项停牌	9.38	-	-	-	600	5,870.38	5,628.00	-	

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 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	3,996,952.21	1.56
	其中：股票	3,996,952.21	1.56
2	基金投资	210,681,770.54	82.25
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	21,310,177.67	8.32
8	其他各项资产	20,171,880.76	7.87
	合计	256,160,781.18	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	20,474.00	0.01
B	采矿业	28,865.50	0.01
C	制造业	2,974,594.08	1.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,955.00	0.01

E	建筑业	70,606.20	0.03
F	批发和零售业	40,674.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	3,927.00	0.00
H	住宿和餐饮业	2,611.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	540,881.63	0.24
J	金融业	-	-
K	房地产业	25,995.00	0.01
L	租赁和商务服务业	23,807.40	0.01
M	科学研究和技术服务业	46,870.80	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	22,689.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	28,122.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	154,879.60	0.07
S	综合	-	-
	合计	3,996,952.21	1.77

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300212	易华录	2,238	134,145.72	0.06
2	002276	万马股份	3,700	126,355.00	0.06
3	002123	荣信股份	5,000	111,250.00	0.05
4	002396	星网锐捷	3,400	109,140.00	0.05
5	002177	御银股份	7,400	106,708.00	0.05
6	300147	香雪制药	3,190	98,252.00	0.04
7	300291	华录百纳	2,400	90,624.00	0.04
8	002665	首航节能	3,100	85,870.00	0.04
9	300135	宝利国际	6,400	80,960.00	0.04
10	300068	南都电源	3,700	77,145.00	0.03

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（<http://www.jsfund.cn>）的半年度报告正文。

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	002439	启明星辰	1,305,229.00	1.09
2	300170	汉得信息	1,217,717.00	1.01
3	002266	浙富控股	1,168,186.00	0.97
4	002312	三泰控股	1,146,910.00	0.95
5	300244	迪安诊断	1,052,422.60	0.88
6	002285	世联行	990,512.00	0.82
7	002573	清新环境	903,847.00	0.75
8	002276	万马股份	897,686.00	0.75
9	300216	千山药机	867,672.00	0.72
10	002440	闰土股份	865,552.00	0.72
11	300020	银江股份	855,405.00	0.71
12	002055	得润电子	842,281.42	0.70
13	002018	华信国际	831,249.00	0.69
14	002501	利源精制	830,034.00	0.69
15	300274	阳光电源	798,774.06	0.67
16	300005	探路者	794,620.00	0.66
17	300212	易华录	793,292.00	0.66
18	300202	聚龙股份	791,247.00	0.66
19	300267	尔康制药	788,237.00	0.66
20	300208	恒顺众昇	752,345.50	0.63

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	300005	探路者	873,973.37	0.73
2	002266	浙富控股	842,961.27	0.70
3	002501	利源精制	703,034.41	0.59
4	002440	闰土股份	672,263.98	0.56
5	002285	世联行	654,345.74	0.54

6	300170	汉得信息	649,142.64	0.54
7	300244	迪安诊断	642,066.35	0.53
8	300147	香雪制药	635,360.68	0.53
9	002089	新海宜	628,583.61	0.52
10	300332	天壕节能	598,634.47	0.50
11	300274	阳光电源	596,313.75	0.50
12	002244	滨江集团	594,384.60	0.49
13	002573	清新环境	594,182.91	0.49
14	002439	启明星辰	582,443.60	0.48
15	300202	聚龙股份	579,831.29	0.48
16	300267	尔康制药	559,206.80	0.47
17	002470	金正大	556,335.29	0.46
18	300295	三六五网	550,951.82	0.46
19	002312	三泰控股	519,366.13	0.43
20	002544	杰赛科技	509,479.34	0.42

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	152,585,362.96
卖出股票收入（成交）总额	107,352,904.41

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前十名资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

7.10 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	嘉实中创 400ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	210,681,770.54	93.14

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.13.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	43,263.84
2	应收证券清算款	17,213,261.67
3	应收股利	-
4	应收利息	3,604.55
5	应收申购款	2,897,420.40
6	其他应收款	14,330.30
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	20,171,880.76

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	300212	易华录	134,145.72	0.06	重大事项停牌
2	002276	万马股份	126,355.00	0.06	重大事项停牌
3	300291	华录百纳	90,624.00	0.04	重大事项停牌
4	002665	首航节能	85,870.00	0.04	重大事项停牌
5	300135	宝利国际	80,960.00	0.04	重大事项停牌
6	300147	香雪制药	48,972.00	0.02	配股未上市

§ 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
7,876	10,514.50	0.00	0.00%	82,812,167.83	100.00%

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	169,548.60	0.20%

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

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
-----------------	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2012 年 3 月 22 日) 基金份额总额	378, 434, 953. 27
本报告期期初基金份额总额	79, 057, 725. 07
本报告期基金总申购份额	144, 647, 377. 33
减: 本报告期基金总赎回份额	140, 892, 934. 57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	82, 812, 167. 83

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2015 年 5 月 8 日本基金管理人发布公告，张峰先生因工作变动不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2015 年 2 月 13 日，北京证监局向我公司下发了“行政监管措施决定书”，责令公司进行为期 3 个月的整改，暂不受理公募基金注册申请，北京证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内控制度进行了全面梳理，逐条落实整改方案，彻底排查业务中存在的风险，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。2015 年 5 月份，公司已经完成相关整改工作并向北京证监局提交了整改完成报告，监管部门对公司整改完成情况进行了现场检查。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	259,919,729.47	100.00%	236,645.62	100.00%	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-

有限公司						
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

(1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；

(2) 公司财务状况良好；

(3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

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

(5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

注 3：申银万国证券股份有限公司更名为申万宏源证券有限公司。

注 4：国都证券有限责任公司更名为国都证券股份有限公司。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	基金交易	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例

国泰君安证券股份有限公司	5,986,820.57	100.00%
--------------	--------------	---------

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

嘉实基金管理有限公司
2015 年 8 月 29 日