

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金 2015 年年度报告摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。董事 Bernd Amlung 未参会。

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 2016 年 3 月 24 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 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 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	208,255,614.26 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

2.4 信息披露方式

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

§ 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	2015 年	2014 年	2013 年 3 月 22 日 (基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	155,117,612.96	9,013,770.81	14,693,389.71
本期利润	137,535,393.11	44,052,658.50	18,726,000.72
加权平均基金份额本期利润	0.4969	0.4447	0.1555
本期加权平均净值利润率	24.63%	34.59%	15.09%
本期基金份额净值增长率	34.43%	34.80%	9.44%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	157,465,090.71	34,284,188.60	5,905,975.12

期末可供分配基金份额利润	0.7561	0.1885	0.0944
期末基金资产净值	412,998,055.18	268,330,078.69	68,461,298.96
期末基金份额净值	1.9831	1.4752	1.0944
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	98.31%	47.52%	9.44%

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	23.32%	1.98%	23.13%	1.94%	0.19%	0.04%
过去六个月	-16.76%	3.08%	-13.51%	3.07%	-3.25%	0.01%
过去一年	34.43%	2.68%	41.26%	2.68%	-6.83%	0.00%
自基金合同生效起至今	98.31%	1.88%	107.17%	1.89%	-8.86%	-0.01%

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：

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

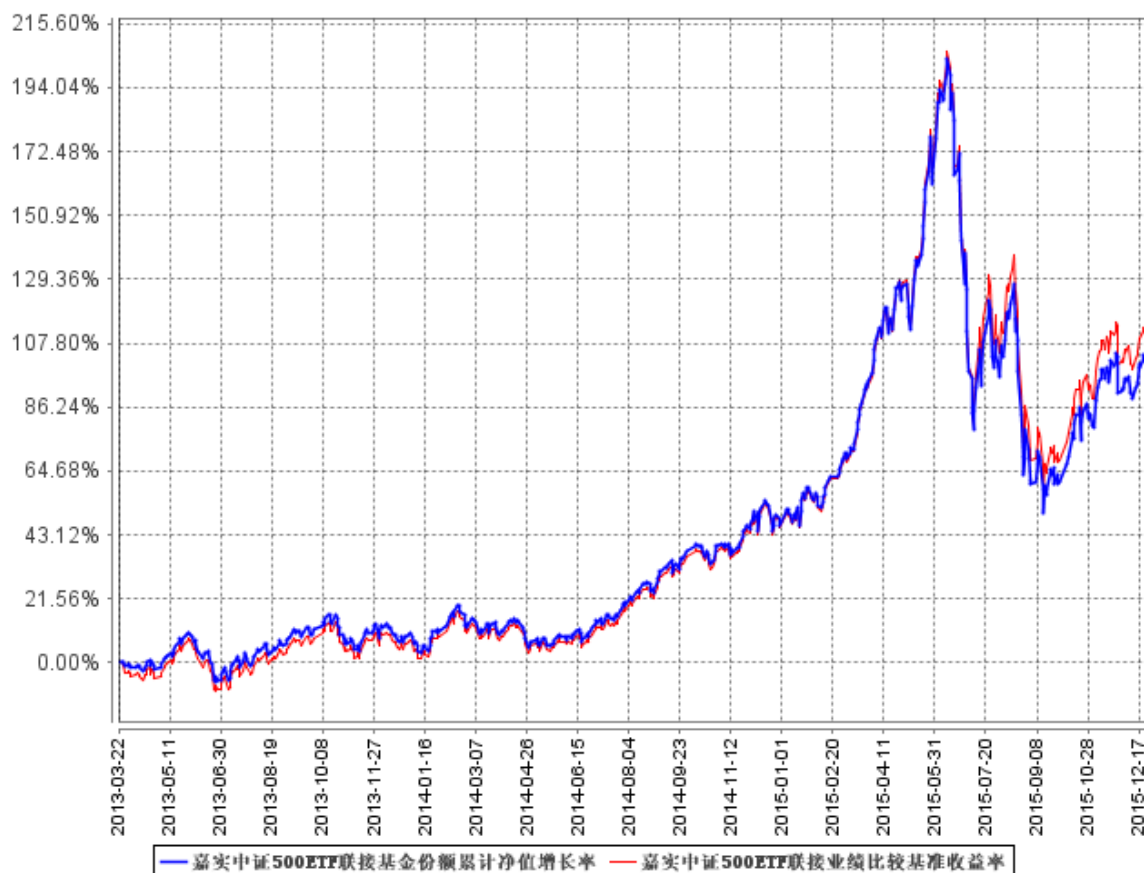
$$\text{Return}(t) = 95\% \times \text{中证 500 指数收益率}(t) + 5\% \times \text{银行活期存款税后利率}$$

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

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

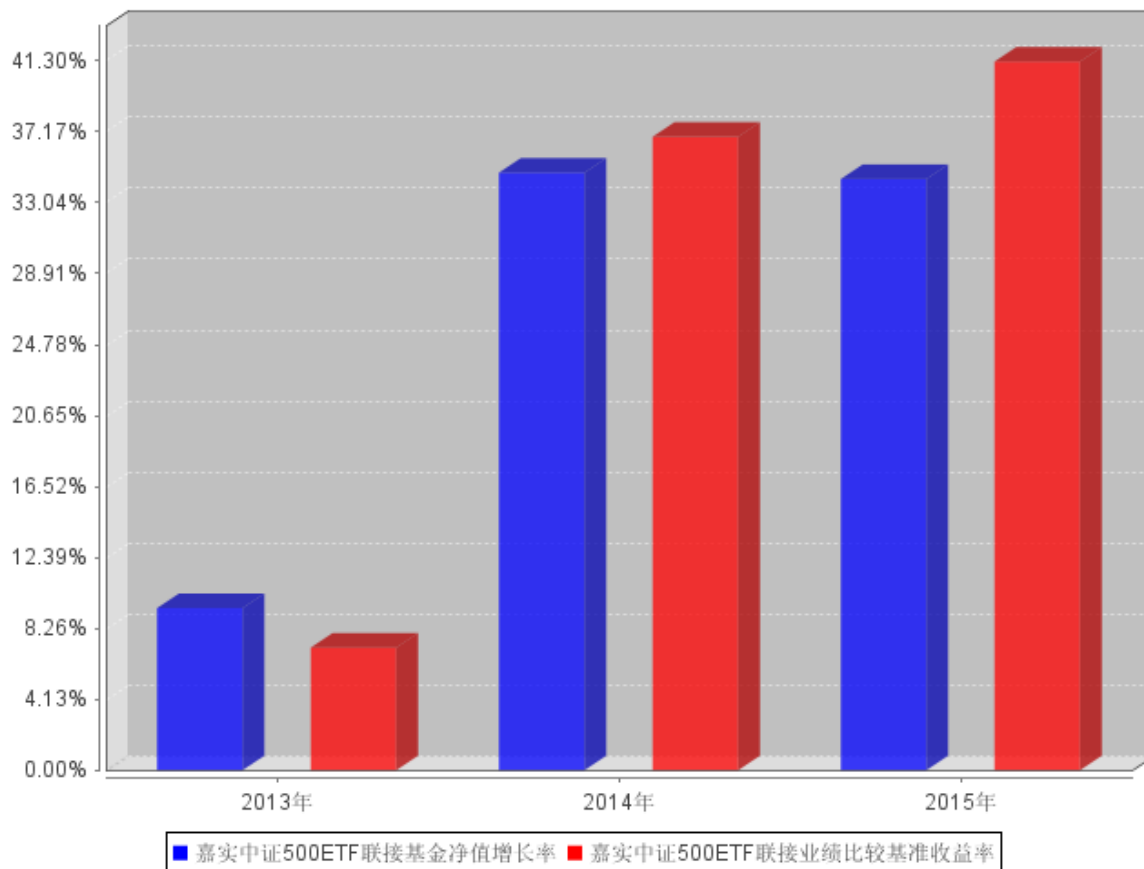


图：嘉实中证 500ETF 联接基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013 年 3 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日)

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“第十二部分（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联接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 3 月 22 日，2013 年度的相关数据根据当年实际存续期（2013 年 3 月 22 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 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、79 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、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300 ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、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、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、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、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、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票。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	2013 年 3 月 22 日	-	17 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

	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			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; (3) 2016 年 1 月 5 日, 本基金管理人发布《关于嘉实中证 500ETF 联接基金经理变更的公告》, 杨宇先生不再担任本基金基金经理, 聘请何如女士、陈正宪先生担任本基金基金经理职务。

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同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 5 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

报告期内，基金日均跟踪误差为 0.13%，年度化拟合偏离度为 2.12%，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报告期内指数成份股停牌比例较大、申购赎回、样本股分红、样本股调整的冲击以及目标 ETF 偏离等因素。

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 1.9831 元；本报告期基金份额净值增长率为 34.43%，业绩比较基准收益率为 41.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证 500 指数在众多指数中，属于高波动、高收益指数，其中长期收益相对大部分指数而言，存在明显优势。随着未来中国经济发展更加倚重机制创新、技术创新，政府资源、市场资源也将较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 43.12%。

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，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（十六（三）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，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

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2015 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师许康玮、洪磊签字出具了“无保留意见的审计报告”(普华永道中天审字(2016)第 20320 号)。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 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联接基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	23,043,706.58	16,934,811.10
结算备付金		7,896,429.23	197,202.31
存出保证金		2,069,466.22	46,379.65
交易性金融资产	7.4.7.2	381,236,188.66	253,649,265.40
其中：股票投资		5,410,766.55	7,841,428.00
基金投资		375,825,422.11	245,807,837.40
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		575,222.37	3,027,849.42
应收利息	7.4.7.5	12,217.73	4,151.20
应收股利		-	-

应收申购款		546,974.11	2,906,511.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	33,863.06	211,440.10
资产总计		415,414,067.96	276,977,610.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,145.41	-
应付赎回款		1,404,360.82	8,151,535.44
应付管理人报酬		27,963.38	10,390.27
应付托管费		5,592.68	2,078.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	600,405.20	92,112.49
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	365,545.29	391,415.75
负债合计		2,416,012.78	8,647,532.02
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	208,255,614.26	181,894,326.90
未分配利润	7.4.7.10	204,742,440.92	86,435,751.79
所有者权益合计		412,998,055.18	268,330,078.69
负债和所有者权益总计		415,414,067.96	276,977,610.71

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9831 元，基金份额总额 208,255,614.26 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联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
一、收入		140,742,676.66	44,822,405.97
1.利息收入		342,807.92	63,596.55
其中：存款利息收入	7.4.7.11	342,807.92	63,595.84

债券利息收入		-	0.71
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		155,043,862.30	9,218,188.67
其中：股票投资收益	7.4.7.12	22,572,451.77	1,252,490.44
基金投资收益	7.4.7.13	130,315,203.01	7,946,427.33
债券投资收益	7.4.7.14	-	179.39
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	2,035,301.82	-
股利收益	7.4.7.16	120,905.70	19,091.51
3.公允价值变动收益	7.4.7.17	-17,582,219.85	35,038,887.69
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.18	2,938,226.29	501,733.06
减：二、费用		3,207,283.55	769,747.47
1. 管理人报酬		270,651.94	54,132.91
2. 托管费		54,130.39	10,826.50
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,478,111.19	317,546.21
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	404,390.03	387,241.85
三、利润总额		137,535,393.11	44,052,658.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润		137,535,393.11	44,052,658.50

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联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	181,894,326.90	86,435,751.79	268,330,078.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	137,535,393.11	137,535,393.11

润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	26,361,287.36	-19,228,703.98	7,132,583.38
其中：1.基金申购款	1,165,449,713.91	1,215,094,366.00	2,380,544,079.91
2.基金赎回款	-1,139,088,426.55	-1,234,323,069.98	-2,373,411,496.53
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）	208,255,614.26	204,742,440.92	412,998,055.18
项目	上年度可比期间 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）	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（本期利润）	-	44,052,658.50	44,052,658.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	119,339,003.06	36,477,118.17	155,816,121.23
其中：1.基金申购款	424,671,893.84	140,767,112.04	565,439,005.88
2.基金赎回款	-305,332,890.78	-104,289,993.87	-409,622,884.65
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）	181,894,326.90	86,435,751.79	268,330,078.69

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 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

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致，会计估计与最近一期年度报告不一致。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

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。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.3 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、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
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 (“嘉实中证 500ETF”)	本基金是该基金的联接基金

7.4.4 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。

7.4.4.1 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 12 月 31 日)及上年度可比期间(2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日), 本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	270,651.94	54,132.91
其中: 支付销售机构的客户维护费	703,387.69	203,461.98

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。

7.4.4.2.2 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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	54,130.39	10,826.50

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。

7.4.4.3 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 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 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。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 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 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

7.4.4.5 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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 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	23,043,706.58	263,546.83	16,934,811.10	58,737.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按适用利率计息。

7.4.4.6 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 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 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。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

报告期末（2015 年 12 月 31 日），本基金持有 50,497,880.00 份目标 ETF 基金份额（2014 年 12 月 31 日：46,260,132.00 份），占其总份额的比例为 43.33%（2014 年 12 月 31 日：66.34%）。

7.4.5 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2015 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。

7.4.5.2 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
000028	国药一致	2015 年 10 月 21 日	重大事项停牌	69.68	-	-	900	58,770.25	62,712.00	-
000426	兴业矿业	2015 年 10 月 28 日	重大事项停牌	7.06	-	-	4,200	28,202.70	29,652.00	-
000829	天音控股	2015 年 11 月 9 日	重大事项停牌	12.22	-	-	3,200	35,540.04	39,104.00	-
000973	佛塑科技	2015 年 12 月 18 日	重大事项停牌	13.00	2016 年 2 月 22 日	11.70	79,200	1,016,957.47	1,029,600.00	-
000982	中银绒业	2014 年 8 月 25 日	重大事项停牌	4.64	2016 年 2 月 25 日	5.10	9,600	44,544.00	44,544.00	-
002011	盾安环境	2015 年 12 月 28 日	重大事项停牌	16.72	2016 年 2 月 22 日	15.05	200	3,320.00	3,344.00	-
002048	宁波华翔	2015 年 11 月 19 日	重大事项停牌	18.34	-	-	1,500	24,532.42	27,510.00	-
002049	同方国芯	2015 年 12 月 11 日	重大事项停牌	63.22	2016 年 3 月 11 日	54.14	1,100	56,221.70	69,542.00	-
002143	印纪传媒	2015 年 12 月 9 日	重大事项停牌	40.55	2016 年 1 月 5 日	36.50	1,001	32,781.84	40,590.55	-
002174	游族网络	2015 年 7 月 23 日	重大事项停牌	89.53	2016 年 2 月 15 日	80.58	300	26,859.00	26,859.00	-

002242	九阳股份	2015 年 12 月 24 日	重大事项停牌	22.68	2016 年 1 月 11 日	20.41	200	4,536.00	4,536.00	-
002371	七星电子	2015 年 10 月 8 日	重大事项停牌	19.28	2016 年 1 月 11 日	21.21	1,000	21,141.66	19,280.00	-
002568	百润股份	2015 年 12 月 21 日	重大事项停牌	42.69	2016 年 1 月 18 日	38.42	13,600	586,787.64	580,584.00	-
002678	珠江钢琴	2015 年 12 月 21 日	重大事项停牌	17.21	2016 年 1 月 19 日	15.49	6,800	117,116.06	117,028.00	-
002698	博实股份	2015 年 12 月 28 日	重大事项停牌	29.33	2016 年 1 月 5 日	26.40	100	2,931.00	2,933.00	-
300043	互动娱乐	2015 年 12 月 17 日	重大事项停牌	15.80	-	-	69,000	1,092,744.90	1,090,200.00	-
300088	长信科技	2015 年 12 月 14 日	重大事项停牌	14.03	2016 年 2 月 29 日	12.63	3,500	44,789.89	49,105.00	-
600120	浙江东方	2015 年 10 月 12 日	重大事项停牌	19.86	-	-	1,500	29,963.94	29,790.00	-
600122	宏图高科	2015 年 12 月 25 日	重大事项停牌	19.42	-	-	700	12,950.00	13,594.00	-
600200	江苏吴中	2015 年 11 月 26 日	重大事项停牌	27.89	2016 年 3 月 16 日	25.10	1,600	39,425.81	44,624.00	-
600219	南山铝业	2015 年 9 月 29 日	重大事项停牌	6.58	2016 年 1 月 25 日	7.00	9,800	66,466.94	64,484.00	-
600429	三元股份	2015 年 9 月 21 日	重大事项停牌	7.29	2016 年 1 月 27 日	7.49	1,600	12,259.69	11,664.00	-
600584	长电科技	2015 年 11 月 30 日	重大事项停牌	22.02	-	-	2,100	40,546.49	46,242.00	-
600654	中安消	2015 年 12 月 14 日	重大事项停牌	28.84	-	-	3,300	113,365.50	95,172.00	-
600699	均胜电子	2015 年 11 月 4 日	重大事项停牌	31.25	2016 年 3 月 10 日	29.00	600	18,418.00	18,750.00	-
600729	重庆百货	2015 年 7 月 24 日	重大事项停牌	32.39	2016 年 1 月 4 日	29.90	300	9,410.47	9,717.00	-
600759	洲际油气	2015 年 9 月 21 日	重大事项停牌	7.85	-	-	3,900	30,175.31	30,615.00	-
600851	海欣股份	2015 年 12 月 21 日	重大事项停牌	14.70	2016 年 1 月 19 日	13.23	41,000	584,459.38	602,700.00	-
600859	王府井	2015 年 12 月 21 日	重大事项停牌	27.22	2016 年 1 月 4 日	27.22	13,700	363,093.94	372,914.00	-
600864	哈投股份	2015 年 10 月 9 日	重大事项停牌	10.88	2016 年 1 月 14 日	11.97	1,600	17,129.85	17,408.00	-
600880	博瑞传播	2015 年 9 月 16 日	重大事项停牌	7.50	2016 年 1 月 18 日	8.25	4,000	37,589.55	30,000.00	-
601000	唐山	2015 年 10 月 29 日	重大事项停牌	8.25	2016 年 2 月 17 日	7.98	7,000	58,395.56	57,750.00	-

	港		牌							
601678	滨化股份	2015 年 12 月 31 日	重大事项停牌	8.02	2016 年 1 月 5 日	7.22	200	1,607.64	1,604.00	-
601717	郑煤机	2015 年 12 月 18 日	重大事项停牌	7.52	-	-	92,400	687,669.31	694,848.00	-

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 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	5,410,766.55	1.30
	其中：股票	5,410,766.55	1.30
2	基金投资	375,825,422.11	90.47
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	30,940,135.81	7.45
8	其他各项资产	3,237,743.49	0.78
	合计	415,414,067.96	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	29,652.00	0.01
C	制造业	4,502,015.00	1.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,408.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	558,446.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	57,750.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	130,281.00	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	40,590.55	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	30,000.00	0.01
S	综合	44,624.00	0.01
	合计	5,410,766.55	1.31

8.3 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	300043	互动娱乐	69,000	1,090,200.00	0.26
2	000973	佛塑科技	79,200	1,029,600.00	0.25
3	601717	郑煤机	92,400	694,848.00	0.17
4	600851	海欣股份	41,000	602,700.00	0.15
5	002568	百润股份	13,600	580,584.00	0.14
6	600859	王府井	13,700	372,914.00	0.09
7	002678	珠江钢琴	6,800	117,028.00	0.03
8	600654	中安消	3,300	95,172.00	0.02

9	002049	同方国芯	1,100	69,542.00	0.02
10	600219	南山铝业	9,800	64,484.00	0.02

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>）的年度报告正文

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	600601	方正科技	5,974,306.60	2.23
2	300253	卫宁软件	5,857,779.50	2.18
3	600895	张江高科	5,845,520.76	2.18
4	601718	际华集团	5,734,811.99	2.14
5	002030	达安基因	5,580,071.93	2.08
6	600881	亚泰集团	5,522,530.54	2.06
7	002405	四维图新	5,361,524.56	2.00
8	600635	大众公用	5,343,469.00	1.99
9	600737	中粮屯河	5,202,775.89	1.94
10	600158	中体产业	5,185,145.10	1.93
11	000998	隆平高科	5,160,777.73	1.92
12	600037	歌华有线	5,155,284.98	1.92
13	600201	生物股份	4,969,229.90	1.85
14	601099	太平洋	4,930,950.49	1.84
15	000997	新大陆	4,813,082.26	1.79
16	601012	隆基股份	4,658,322.00	1.74
17	002183	怡亚通	4,649,251.00	1.73
18	600410	华胜天成	4,588,059.00	1.71
19	600219	南山铝业	4,491,832.00	1.67
20	600811	东方集团	4,471,216.00	1.67

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	002405	四维图新	4,537,092.93	1.69
2	600635	大众公用	4,164,432.92	1.55
3	002030	达安基因	4,030,547.61	1.50
4	300253	卫宁软件	3,826,962.29	1.43
5	600158	中体产业	3,782,488.18	1.41
6	600201	生物股份	3,753,261.30	1.40
7	000997	新大陆	3,685,482.02	1.37
8	002004	华邦健康	3,679,563.13	1.37
9	600601	方正科技	3,642,768.42	1.36
10	600881	亚泰集团	3,609,804.62	1.35
11	600079	人福医药	3,500,776.48	1.30
12	002701	奥瑞金	3,452,049.31	1.29
13	000998	隆平高科	3,416,407.62	1.27
14	600816	安信信托	3,376,202.56	1.26
15	000012	南玻A	3,369,320.48	1.26
16	600522	中天科技	3,323,786.31	1.24
17	600694	大商股份	3,306,112.23	1.23
18	600655	豫园商城	3,270,594.00	1.22
19	600525	长园集团	3,260,786.63	1.22
20	600376	首开股份	3,256,778.34	1.21

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	1,096,390,235.17
卖出股票收入（成交）总额	848,259,870.49

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。

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 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	嘉实基金管理有限公司	375,825,422.11	91.00

8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1601	中证 500 股指期货 IC1601 合约	6	8,878,800.00	544,298.18	-
公允价值变动总额合计(元)					544,298.18
股指期货投资本期收益(元)					2,035,301.82
股指期货投资本期公允价值变动(元)					544,298.18

8.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于股指期货的目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

8.12 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1

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。

8.13.2

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。

8.13.3 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	2,069,466.22
2	应收证券清算款	575,222.37
3	应收股利	-
4	应收利息	12,217.73
5	应收申购款	546,974.11
6	其他应收款	33,863.06
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	3,237,743.49

8.13.4 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。

8.13.5 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	300043	互动娱乐	1,090,200.00	0.26	重大事项停牌
2	000973	佛塑科技	1,029,600.00	0.25	重大事项停牌
3	601717	郑煤机	694,848.00	0.17	重大事项停牌
4	600851	海欣股份	602,700.00	0.15	重大事项停牌
5	002568	百润股份	580,584.00	0.14	重大事项停牌
6	600859	王府井	372,914.00	0.09	重大事项停牌
7	002678	珠江钢琴	117,028.00	0.03	重大事项停牌
8	600654	中安消	95,172.00	0.02	重大事项停牌
9	002049	同方国芯	69,542.00	0.02	重大事项停牌
10	600219	南山铝业	64,484.00	0.02	重大事项停牌

§ 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

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
24,130	8,630.57	438,749.74	0.21%	207,816,864.52	99.79%

9.2 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	179,552.25	0.09%

9.3 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	10~50
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 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	181,894,326.90
本报告期基金总申购份额	1,165,449,713.91
减:本报告期基金总赎回份额	1,139,088,426.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	208,255,614.26

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。

§ 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

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

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

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 3 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

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。

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	
国信证券股份有限公司	1	948,313,197.32	48.77%	663,855.46	48.77%	-
华泰证券股份有限公司	1	530,573,404.50	27.28%	371,401.88	27.28%	-
北京高华证券有限责任公司	1	383,762,769.24	19.73%	268,635.86	19.73%	-
广发证券股份有限公司	2	53,823,873.73	2.77%	37,676.83	2.77%	-
申万宏源证券有限公司	1	28,146,044.07	1.45%	19,702.18	1.45%	-
中信证券股份有限公司	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	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	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。

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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	417,944,720.78	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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2016 年 3 月 29 日