

嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资
基金联接基金
2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	23
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	65
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.....	65
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.....	65
7.10 期末投资目标基金明细.....	65
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	65
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
7.13 投资组合报告附注.....	65
§8 基金份额持有人信息.....	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
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.....	67
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 其他重大事件.....	73
§11 备查文件目录.....	74

11.1 备查文件目录.....	74
11.2 存放地点.....	74
11.3 查阅方式.....	74

§ 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	81,183,898.02 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。

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	郭明
	联系电话	(010) 65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010) 65182266	(010)66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验	北京市西城区复兴门内大街 55

	区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元	号
办公地址	北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100005	100140
法定代表人	邓红国	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-2,451,891.23
本期利润	-10,105,016.78
加权平均基金份额本期利润	-0.1247
本期加权平均净值利润率	-6.87%
本期基金份额净值增长率	-6.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	53,508,243.42
期末可供分配基金份额利润	0.6591
期末基金资产净值	142,710,370.04
期末基金份额净值	1.7579
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	75.79%

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	3.53%	0.95%	3.57%	0.95%	-0.04%	0.00%

过去三个月	-5.83%	0.93%	-5.83%	0.94%	0.00%	-0.01%
过去六个月	-6.86%	0.90%	-6.57%	0.91%	-0.29%	-0.01%
过去一年	-13.46%	0.93%	-12.78%	0.94%	-0.68%	-0.01%
过去三年	30.65%	1.99%	49.96%	2.03%	-19.31%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	75.79%	1.76%	94.39%	1.81%	-18.60%	-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：

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

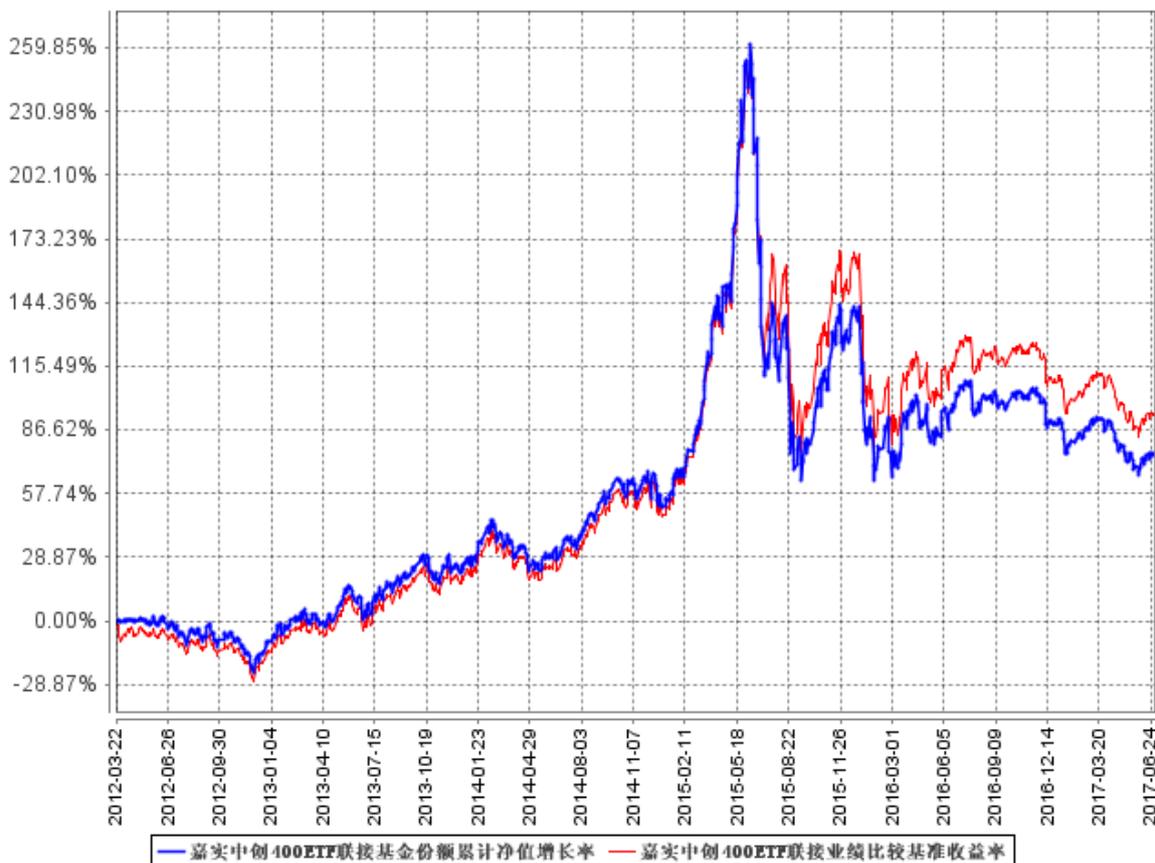
$$\text{Return}(t) = 95\% \times \text{中创 400 指数收益率}(t) + 5\% \times \text{银行活期存款税后利率}$$

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

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 2017 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 2017 年 6 月 30 日, 基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、129 只开放式证券投资基金, 具体包括嘉实元和、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 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)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、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、嘉实周期优选混合、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、嘉实新消费股票基金、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、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实新添华定期混合、嘉实丰和灵活

配置混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、嘉实原油 (QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳康纯债债券、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接。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		
陈正宪	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实中创 400ETF、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实创业板 ETF 基金经理	2016 年 3 月 24 日	-	12 年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,中国台湾籍。
刘珈吟	本基金、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实中创 400ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实中关村 A 股 ETF 基金经理	2016 年 3 月 24 日	-	8 年	2009 年加入嘉实基金管理有限公司,曾任指数投资部指数研究员一职。现任指数投资部基金经理。

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；（3）本基金基金经理刘珈吟女士因个人身体原因休假超过 30 日，在其休假期间，本基金暂由我公司基金经理何如女士、陈正宪先生代为履行基金经理职责。该事项已于 2017 年 4 月 28 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。本基金基金经理刘珈吟女士已结束休假，自 2017 年 8 月 10 日起恢复履行基金经理职务。该事项已于 2017 年 8 月 10 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 6 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 0.02%，年化跟踪误差为 0.28%。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。

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 1.7579 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.86%，业绩比较基准收益率为-6.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，将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，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、合规部等部门负责人组成，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

(1) 报告期内本基金未实施利润分配；

(2) 根据本报告 3.1.1 “本期利润”为-10,105,016.78 元，以及基金合同（十五（三）基金收益分配原则）约定，因此报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的

相关约定。

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 2017 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,598,477.76	8,480,612.36
结算备付金		32,465.69	129,172.42
存出保证金		12,743.23	13,670.97
交易性金融资产	6.4.7.2	135,155,239.67	144,562,078.44
其中：股票投资		4,099,938.15	1,343,000.54
基金投资		131,055,301.52	143,219,077.90
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		430,310.19	-
应收利息	6.4.7.5	1,414.28	1,748.93
应收股利		-	-
应收申购款		81,229.12	57,095.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	8,201.35
资产总计		143,311,879.94	153,252,580.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		-	333,433.28
应付赎回款		418,957.34	404,421.55
应付管理人报酬		5,322.02	6,101.14
应付托管费		1,064.42	1,220.21
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	26,113.13	49,358.02
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	150,052.99	201,461.37
负债合计		601,509.90	995,995.57
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	81,183,898.02	80,675,757.79
未分配利润	6.4.7.10	61,526,472.02	71,580,827.04
所有者权益合计		142,710,370.04	152,256,584.83
负债和所有者权益总计		143,311,879.94	153,252,580.40

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7579 元，基金份额总额 81,183,898.02 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-9,907,150.81	-22,984,413.04
1.利息收入		29,826.50	34,739.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	29,826.39	34,739.25
债券利息收入		0.11	0.70
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（损失以“-”填列）		-2,324,473.70	-3,393,287.31
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-411,148.56	-954,379.29
基金投资收益	6.4.7.13	-1,933,125.2 1	-2,456,081.17
债券投资收益	6.4.7.14	134.77	444.72
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	19,665.30	16,728.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,653,125.55	-19,749,124.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	40,621.94	123,258.34
减：二、费用		197,865.97	254,426.78
1. 管理人报酬		30,883.70	35,948.37
2. 托管费		6,176.75	7,189.65
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	60,304.64	110,447.07
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	100,500.88	100,841.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,105,016.78	-23,238,839.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,105,016.78	-23,238,839.82

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	80,675,757.79	71,580,827.04	152,256,584.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,105,016.78	-10,105,016.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	508,140.23	50,661.76	558,801.99
其中：1. 基金申购款	23,731,357.14	19,068,924.10	42,800,281.24
2. 基金赎回款	-23,223,216.91	-19,018,262.34	-42,241,479.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以	-	-	-

“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	81,183,898.02	61,526,472.02	142,710,370.04
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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)	73,444,146.06	101,074,226.01	174,518,372.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-23,238,839.82	-23,238,839.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	12,206,839.18	10,496,495.11	22,703,334.29
其中：1. 基金申购款	65,595,866.78	58,000,742.76	123,596,609.54
2. 基金赎回款	-53,389,027.60	-47,504,247.65	-100,893,275.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	85,650,985.24	88,331,881.30	173,982,866.54

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
基金管理人负责人

 王红
主管会计工作负责人

 张公允
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]13 号《关于核准嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 378,368,900.43 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 063 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2012 年 3 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 378,434,953.27 份基金份额,其中认购资金利息折合 66,052.84 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为中创 400 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中创 400 指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,在正常市场情况下,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%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定,本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为:中创 400 指数收益率 \times 95%+银行活期存款税后利率 \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前,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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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,股票的股息、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。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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	7,598,477.76
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	7,598,477.76

注：定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,107,103.18	4,099,938.15	-7,165.03
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	156,492,413.33	131,055,301.52	-25,437,111.81	
其他		-	-	-
合计	160,599,516.51	135,155,239.67	-25,444,276.84	

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按目标 ETF 于估值日的份额净值确定公允价值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,396.01
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	13.14
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	5.13
合计	1,414.28

6.4.7.6 其他资产

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	26,113.13
银行间市场应付交易费用	-
合计	26,113.13

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	872.23
预提费用	149,180.76
应付指数使用费	-
其他	-
合计	150,052.99

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	80,675,757.79	80,675,757.79
本期申购	23,731,357.14	23,731,357.14

本期赎回(以“-”号填列)	-23,223,216.91	-23,223,216.91
本期末	81,183,898.02	81,183,898.02

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	55,647,116.13	15,933,710.91	71,580,827.04
本期利润	-2,451,891.23	-7,653,125.55	-10,105,016.78
本期基金份额交易产生的变动数	313,018.52	-262,356.76	50,661.76
其中：基金申购款	16,005,066.51	3,063,857.59	19,068,924.10
基金赎回款	-15,692,047.99	-3,326,214.35	-19,018,262.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,508,243.42	8,018,228.60	61,526,472.02

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	28,985.32
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	404.41
其他	436.66
合计	29,826.39

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-139,535.85
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-271,612.71
合计	-411,148.56

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	19,455,283.52
减：卖出股票成本总额	19,594,819.37
买卖股票差价收入	-139,535.85

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
申购基金份额总额	11,319,000.00
减：现金支付申购款总额	1,117,028.55
减：申购股票成本总额	10,473,584.16
申购差价收入	-271,612.71

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	13,877,407.02
减：卖出/赎回基金成本总额	15,810,532.23
基金投资收益	-1,933,125.21

6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	934.88
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	800.00
减：应收利息总额	0.11
买卖债券差价收入	134.77

6.4.7.15 衍生工具收益

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	19,665.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	19,665.30

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,653,125.55
——股票投资	19,319.87
——债券投资	-
——基金投资	-7,672,445.42
——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	-7,653,125.55

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	11,445.29
基金转出费收入	29,176.65
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
其他	-
合计	40,621.94

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	60,304.64
银行间市场交易费用	-
合计	60,304.64

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	74,385.57
债券托管账户维护费	-
银行划款手续费	1,320.12
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
其他	-
合计	100,500.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	30,883.70	35,948.37
其中：支付销售机构的客户维护费	78,551.23	-

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) \times 0.5% / 当年天数。

注 2: 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议, 客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,176.75	7,189.65

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) \times 0.1% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期 (2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日) 及上年度可比期间 (2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日), 本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内 (2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日) 及上年度可比期间 (2016 年 1 月 1 日至 2016 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 (2017 年 6 月 30 日) 及上年度末 (2016 年 12 月 31 日), 其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	7,598,477.76	28,985.32	11,009,234.95	33,162.38

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

报告期末（2017 年 6 月 30 日），本基金持有 70,623,108.00 份目标 ETF 基金份额（2016 年 12 月 31 日：71,684,808.00 份），占其总份额的比例为 94.72%（2016 年 12 月 31 日 94.87%）。

6.4.11 利润分配情况

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 06 月 30 日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002013	中航机电	2017年5月12日	重大事项停牌	10.33	2017年8月2日	11.36	2,100	23,727.91	21,693.00	-
002025	航天电器	2016年9月12日	重大事项停牌	24.95	2017年7月4日	22.46	800	19,534.11	19,960.00	-
002070	*ST众和	2017年5月2日	重大事项停牌	10.17	-	-	1,300	15,142.08	13,221.00	-
002075	沙钢	2016年9月	重大事项	16.12	-	-	2,600	41,691.33	41,912.00	-

	股份	19 日	项停牌							
002128	露天 煤业	2017年3月 17 日	重大事 项停牌	8.70	2017年8 月14日	9.57	600	5,281.41	5,220.00	-
002143	印纪 传媒	2017年4月 18 日	重大事 项停牌	24.93	-	-	600	16,932.93	14,958.00	-
002168	深圳 惠程	2017年1月 23 日	重大事 项停牌	16.99	-	-	1,600	25,918.92	27,184.00	-
002256	兆新 股份	2017年6月 5 日	重大事 项停牌	4.39	-	-	2,000	10,922.49	8,780.00	-
002260	德奥 通航	2016年12 月5日	重大事 项停牌	23.10	-	-	600	14,628.38	13,860.00	-
002263	大东 南	2017年4月 24 日	重大事 项停牌	3.28	-	-	3,600	12,483.65	11,808.00	-
002358	森源 电气	2017年5月 12 日	重大事 项停牌	17.02	2017年7 月12日	16.68	700	13,156.16	11,914.00	-
002399	海普 瑞	2017年4月 28 日	重大事 项停牌	20.23	-	-	100	2,106.48	2,023.00	-
002418	康盛 股份	2017年3月 20 日	重大事 项停牌	9.31	2017年7 月10日	9.30	500	4,963.45	4,655.00	-
002447	壹桥 股份	2017年5月 2 日	重大事 项停牌	9.00	-	-	1,700	15,598.15	15,300.00	-
002504	*ST弘 高	2017年5月 2 日	重大事 项停牌	8.10	-	-	1,000	8,177.17	8,100.00	-
002505	大康 农业	2017年3月 13 日	重大事 项停牌	3.50	-	-	2,010	7,076.36	7,035.00	-
002547	春兴 精工	2017年2月 20 日	重大事 项停牌	10.89	2017年8 月18日	9.80	1,100	10,743.67	11,979.00	-
002600	江粉 磁材	2017年2月 27 日	重大事 项停牌	11.46	2017年8 月9日	6.25	700	7,260.41	8,022.00	-

002619	巨龙管业	2017年5月24日	重大事项停牌	6.37	-	-	900	7,500.33	5,733.00	-
002622	融钰集团	2017年4月20日	重大事项停牌	12.30	-	-	2,600	32,923.68	31,980.00	-
002625	光启技术	2017年4月13日	重大事项停牌	36.36	-	-	300	10,764.47	10,908.00	-
002638	勤上股份	2017年4月26日	重大事项停牌	8.14	-	-	1,600	15,282.71	13,024.00	-
002642	荣之联	2017年4月10日	重大事项停牌	25.06	2017年7月7日	22.54	700	16,503.72	17,542.00	-
002650	加加食品	2017年4月20日	重大事项停牌	5.88	-	-	1,500	9,555.62	8,820.00	-
002681	奋达科技	2017年6月22日	重大事项停牌	12.59	2017年7月3日	12.70	900	11,474.69	11,331.00	-
002711	欧浦智网	2017年6月26日	重大事项停牌	18.79	2017年7月17日	11.94	700	12,910.72	13,153.00	-
300065	海兰信	2016年12月8日	重大事项停牌	25.63	2017年7月6日	23.07	600	15,205.83	15,378.00	-
300075	数字政通	2017年6月29日	重大事项停牌	20.94	2017年7月17日	18.86	500	11,392.95	10,470.00	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大事项停牌	15.75	2017年8月9日	14.50	2,900	44,802.74	45,675.00	-
300098	高新兴	2017年6月22日	重大事项停牌	12.90	2017年7月3日	13.18	1,200	14,565.38	15,480.00	-
300134	大富科技	2017年2月9日	重大事项停牌	23.36	-	-	900	21,380.60	21,024.00	-
300145	中金环境	2017年6月28日	重大事项停牌	16.92	-	-	1,300	21,048.45	21,996.00	-
300148	天舟	2017年1月	重大事项	15.57	2017年8		910	13,460.00	14,168.70	-

	文化	25 日	项停牌		月 1 日	14.01					
300152	科融 环境	2017 年 5 月 12 日	重大事 项停牌	7.89	2017 年 7 月 12 日	7.41	1,300	11,840.95	10,257.00	-	
300252	金信 诺	2017 年 4 月 27 日	重大事 项停牌	21.65	2017 年 7 月 27 日	19.49	400	10,018.50	8,660.00	-	
300267	尔康 制药	2017 年 5 月 10 日	重大事 项停牌	11.46	-	-	1,600	20,997.04	18,336.00	-	
300271	华宇 软件	2017 年 6 月 22 日	重大事 项停牌	16.59	2017 年 7 月 4 日	16.80	1,198	19,539.07	19,874.82	-	
300291	华录 百纳	2017 年 4 月 19 日	重大事 项停牌	20.02	-	-	1,300	26,075.46	26,026.00	-	
300364	中文 在线	2017 年 2 月 13 日	重大事 项停牌	37.28	-	-	300	10,779.00	11,184.00	-	
300367	东方 网力	2016 年 12 月 15 日	重大事 项停牌	20.00	2017 年 7 月 3 日	18.01	950	20,762.42	19,000.00	-	
300413	快乐 购	2017 年 4 月 5 日	重大事 项停牌	20.29	-	-	500	10,611.85	10,145.00	-	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 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创 400 指数及目标 ETF 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。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%。本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

基金的银行存款存放在托管人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。

于本报告期末，本基金未持有债券投资(上年度末：无)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但投资目标 ETF 基金和标的指数成份股不受此限。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,598,477.76	-	-	-	7,598,477.76
结算备付金	32,465.69	-	-	-	32,465.69
存出保证金	12,743.23	-	-	-	12,743.23
交易性金融资产	-	-	-	135,155,239.67	135,155,239.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	430,310.19	430,310.19
应收利息	-	-	-	1,414.28	1,414.28
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	15,487.36	-	-	65,741.76	81,229.12
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,659,174.04	-	-	135,652,705.90	143,311,879.94
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	-	-	-	418,957.34	418,957.34
应付管理人报酬	-	-	-	5,322.02	5,322.02
应付托管费	-	-	-	1,064.42	1,064.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	26,113.13	26,113.13
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	150,052.99	150,052.99
负债总计	-	-	-	601,509.90	601,509.90
利率敏感度缺口	7,659,174.04	-	-	135,051,196.00	142,710,370.04
上年度末 2016 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	8,480,612.36	-	-	-	8,480,612.36
结算备付金	129,172.42	-	-	-	129,172.42
存出保证金	13,670.97	-	-	-	13,670.97
交易性金融资产	-	-	-	144,562,078.44	144,562,078.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,748.93	1,748.93
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	23,879.90	-	-	33,216.03	57,095.93
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	8,201.35	8,201.35
资产总计	8,647,335.65	-	-	144,605,244.75	153,252,580.40
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	-	-	-	333,433.28	333,433.28
应付赎回款	-	-	-	404,421.55	404,421.55
应付管理人报酬	-	-	-	6,101.14	6,101.14
应付托管费	-	-	-	1,220.21	1,220.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	49,358.02	49,358.02
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	201,461.37	201,461.37
负债总计	-	-	-	995,995.57	995,995.57
利率敏感度缺口	8,647,335.65	-	-	143,609,249.18	152,256,584.83

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2016 年 12 月 31 日：同)。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	4,099,938.15	2.87	1,343,000.54	0.88
交易性金融资产-基金投资	131,055,301.52	91.83	143,219,077.90	94.06
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	135,155,239.67	94.71	144,562,078.44	94.95

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月 30日）	上年度末（2016年12月 31日）
	业绩比较基准上升 5%	7,074,809.53	7,530,349.55
	业绩比较基准下降 5%	-7,074,809.53	-7,530,349.55

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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

于本报告期末，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 134,527,450.15 元，属于第二层次的余额为 627,789.52 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 144,061,187.94 元，第二层次 500,890.50 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。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,099,938.15	2.86
	其中：股票	4,099,938.15	2.86
2	基金投资	131,055,301.52	91.45
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,630,943.45	5.32
8	其他各项资产	525,696.82	0.37
9	合计	143,311,879.94	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	79,766.00	0.06
B	采矿业	33,787.00	0.02
C	制造业	2,753,459.43	1.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,568.00	0.02

E	建筑业	138,960.60	0.10
F	批发和零售业	127,972.50	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	23,977.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	608,715.72	0.43
J	金融业	7,632.00	0.01
K	房地产业	31,309.00	0.02
L	租赁和商务服务业	57,631.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	21,531.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	55,948.20	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	43,954.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	92,726.70	0.06
S	综合	-	-
	合计	4,099,938.15	2.87

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300088	长信科技	2,900	45,675.00	0.03
2	002075	沙钢股份	2,600	41,912.00	0.03
3	002271	东方雨虹	1,000	37,100.00	0.03
4	002622	融钰集团	2,600	31,980.00	0.02
5	300115	长盈精密	1,000	29,180.00	0.02
6	300266	兴源环境	900	27,648.00	0.02

7	002168	深圳惠程	1,600	27,184.00	0.02
8	300296	利亚德	1,400	26,320.00	0.02
9	300291	华录百纳	1,300	26,026.00	0.02
10	002366	台海核电	500	23,455.00	0.02
11	002050	三花智控	1,400	22,848.00	0.02
12	300142	沃森生物	1,800	22,248.00	0.02
13	300145	中金环境	1,300	21,996.00	0.02
14	002311	海大集团	1,200	21,924.00	0.02
15	002185	华天科技	3,000	21,720.00	0.02
16	002013	中航机电	2,100	21,693.00	0.02
17	300134	大富科技	900	21,024.00	0.01
18	300015	爱尔眼科	900	20,934.00	0.01
19	002025	航天电器	800	19,960.00	0.01
20	300271	华宇软件	1,198	19,874.82	0.01
21	300159	新研股份	1,500	19,860.00	0.01
22	002384	东山精密	800	19,760.00	0.01
23	002583	海能达	1,200	19,308.00	0.01
24	002051	中工国际	920	19,071.60	0.01
25	300367	东方网力	950	19,000.00	0.01
26	002343	慈文传媒	500	18,930.00	0.01
27	002217	合力泰	1,900	18,772.00	0.01
28	002138	顺络电子	1,000	18,580.00	0.01
29	002019	亿帆医药	1,100	18,348.00	0.01
30	300267	尔康制药	1,600	18,336.00	0.01
31	002635	安洁科技	500	18,110.00	0.01
32	300355	蒙草生态	1,680	18,043.20	0.01
33	002555	三七互娱	700	17,899.00	0.01
34	002642	荣之联	700	17,542.00	0.01

35	002491	通鼎互联	1,300	17,472.00	0.01
36	300197	铁汉生态	1,300	17,264.00	0.01
37	300122	智飞生物	900	17,199.00	0.01
38	002624	完美世界	500	17,150.00	0.01
39	300203	聚光科技	600	16,872.00	0.01
40	002048	宁波华翔	800	16,688.00	0.01
41	002408	齐翔腾达	1,500	16,620.00	0.01
42	002431	棕榈股份	1,500	16,530.00	0.01
43	300324	旋极信息	900	16,416.00	0.01
44	002221	东华能源	1,500	16,365.00	0.01
45	002714	牧原股份	600	16,332.00	0.01
46	002078	太阳纸业	2,200	16,170.00	0.01
47	002028	思源电气	1,000	15,940.00	0.01
48	002174	游族网络	500	15,880.00	0.01
49	002250	联化科技	1,100	15,730.00	0.01
50	002462	嘉事堂	400	15,716.00	0.01
51	300098	高新兴	1,200	15,480.00	0.01
52	002131	利欧股份	4,700	15,463.00	0.01
53	300065	海兰信	600	15,378.00	0.01
54	300166	东方国信	1,140	15,310.20	0.01
55	002447	壹桥股份	1,700	15,300.00	0.01
56	002665	首航节能	2,100	15,120.00	0.01
57	002373	千方科技	1,100	15,004.00	0.01
58	002191	劲嘉股份	1,600	14,976.00	0.01
59	002143	印纪传媒	600	14,958.00	0.01
60	002640	跨境通	700	14,875.00	0.01
61	002501	利源精制	1,300	14,781.00	0.01
62	300257	开山股份	700	14,756.00	0.01

63	002389	南洋科技	700	14,742.00	0.01
64	002589	瑞康医药	950	14,630.00	0.01
65	300347	泰格医药	600	14,520.00	0.01
66	002602	世纪华通	400	14,504.00	0.01
67	002411	必康股份	500	14,460.00	0.01
68	300294	博雅生物	350	14,434.00	0.01
69	300274	阳光电源	1,300	14,417.00	0.01
70	300182	捷成股份	1,500	14,340.00	0.01
71	300137	先河环保	600	14,280.00	0.01
72	300090	盛运环保	1,500	14,205.00	0.01
73	300148	天舟文化	910	14,168.70	0.01
74	002002	鸿达兴业	1,800	14,094.00	0.01
75	002517	恺英网络	400	14,076.00	0.01
76	002444	巨星科技	900	14,022.00	0.01
77	002603	以岭药业	800	13,968.00	0.01
78	002262	恩华药业	920	13,919.60	0.01
79	002022	科华生物	800	13,896.00	0.01
80	002260	德奥通航	600	13,860.00	0.01
81	002368	太极股份	500	13,845.00	0.01
82	002043	兔宝宝	1,000	13,840.00	0.01
83	300199	翰宇药业	900	13,806.00	0.01
84	002477	雏鹰农牧	3,100	13,733.00	0.01
85	002544	杰赛科技	600	13,680.00	0.01
86	300026	红日药业	2,900	13,659.00	0.01
87	002570	贝因美	1,000	13,600.00	0.01
88	002497	雅化集团	1,400	13,580.00	0.01
89	002672	东江环保	800	13,512.00	0.01
90	300068	南都电源	800	13,472.00	0.01

91	300001	特锐德	800	13,408.00	0.01
92	002595	豪迈科技	600	13,338.00	0.01
93	002281	光迅科技	600	13,332.00	0.01
94	002070	*ST 众和	1,300	13,221.00	0.01
95	002036	联创电子	800	13,200.00	0.01
96	002266	浙富控股	2,700	13,176.00	0.01
97	002711	欧浦智网	700	13,153.00	0.01
98	002522	浙江众成	800	13,080.00	0.01
99	002390	信邦制药	1,500	13,065.00	0.01
100	002638	勤上股份	1,600	13,024.00	0.01
101	300207	欣旺达	1,100	12,969.00	0.01
102	002117	东港股份	500	12,940.00	0.01
103	002261	拓维信息	1,100	12,881.00	0.01
104	300287	飞利信	1,400	12,852.00	0.01
105	002285	世联行	1,600	12,832.00	0.01
106	002268	卫 士 通	760	12,783.20	0.01
107	300463	迈克生物	500	12,750.00	0.01
108	002630	华西能源	1,100	12,749.00	0.01
109	002468	申通快递	500	12,705.00	0.01
110	300118	东方日升	900	12,645.00	0.01
111	002643	万润股份	850	12,546.00	0.01
112	300073	当升科技	500	12,470.00	0.01
113	002244	滨江集团	1,800	12,456.00	0.01
113	300020	银江股份	900	12,456.00	0.01
114	002155	湖南黄金	1,300	12,441.00	0.01
115	002018	华信国际	1,800	12,330.00	0.01
116	002023	海特高新	1,200	12,324.00	0.01
117	002421	达实智能	2,000	12,240.00	0.01

118	300216	千山药机	500	12,225.00	0.01
119	002440	闰土股份	800	12,208.00	0.01
120	002104	恒宝股份	1,300	12,207.00	0.01
121	300053	欧比特	900	12,105.00	0.01
122	002354	天神娱乐	560	12,040.00	0.01
123	300136	信维通信	300	12,006.00	0.01
124	002547	春兴精工	1,100	11,979.00	0.01
125	002436	兴森科技	1,900	11,970.00	0.01
126	002358	森源电气	700	11,914.00	0.01
127	002032	苏泊尔	290	11,904.50	0.01
128	002299	圣农发展	800	11,896.00	0.01
129	300009	安科生物	723	11,864.43	0.01
130	002263	大东南	3,600	11,808.00	0.01
130	300284	苏文科	600	11,808.00	0.01
131	002396	星网锐捷	600	11,610.00	0.01
132	300054	鼎龙股份	1,140	11,593.80	0.01
133	002449	国星光电	700	11,585.00	0.01
134	002375	亚厦股份	1,300	11,583.00	0.01
135	002716	金贵银业	600	11,514.00	0.01
136	002089	新海宜	1,700	11,509.00	0.01
137	002664	信质电机	400	11,448.00	0.01
138	002055	得润电子	500	11,365.00	0.01
139	002011	盾安环境	1,000	11,350.00	0.01
140	300222	科大智能	500	11,345.00	0.01
141	002681	奋达科技	900	11,331.00	0.01
142	300496	中科创达	400	11,320.00	0.01
143	002512	达华智能	700	11,305.00	0.01
144	002056	横店东磁	1,500	11,250.00	0.01

145	002503	搜于特	1,600	11,248.00	0.01
146	300316	晶盛机电	900	11,241.00	0.01
147	002047	宝鹰股份	1,300	11,232.00	0.01
148	300185	通裕重工	4,300	11,223.00	0.01
149	002341	新纶科技	600	11,190.00	0.01
150	300364	中文在线	300	11,184.00	0.01
151	002151	北斗星通	400	11,180.00	0.01
152	002317	众生药业	900	11,178.00	0.01
153	300226	上海钢联	300	11,160.00	0.01
154	002123	梦网荣信	1,000	11,110.00	0.01
155	002326	永太科技	800	11,088.00	0.01
155	300083	劲胜精密	1,200	11,088.00	0.01
156	002126	银轮股份	1,100	11,066.00	0.01
157	002376	新北洋	800	10,976.00	0.01
158	002325	洪涛股份	1,500	10,950.00	0.01
159	002145	中核钛白	1,800	10,944.00	0.01
160	002437	誉衡药业	1,500	10,920.00	0.01
161	002625	光启技术	300	10,908.00	0.01
162	002542	中化岩土	900	10,881.00	0.01
163	002280	联络互动	1,000	10,880.00	0.01
164	002402	和而泰	1,100	10,846.00	0.01
165	002245	澳洋顺昌	1,200	10,824.00	0.01
166	300157	恒泰艾普	1,100	10,802.00	0.01
167	300116	坚瑞沃能	1,000	10,750.00	0.01
168	002190	成飞集成	400	10,720.00	0.01
169	002479	富春环保	900	10,710.00	0.01
170	300352	北信源	1,850	10,674.50	0.01
171	002254	泰和新材	800	10,640.00	0.01

172	002067	景兴纸业	1,800	10,566.00	0.01
173	002237	恒邦股份	1,000	10,490.00	0.01
174	300075	数字政通	500	10,470.00	0.01
175	002773	康弘药业	200	10,460.00	0.01
176	002308	威创股份	800	10,440.00	0.01
177	002508	老板电器	240	10,435.20	0.01
178	002095	生意宝	300	10,368.00	0.01
179	300010	立思辰	800	10,360.00	0.01
180	002121	科陆电子	1,200	10,320.00	0.01
181	002210	飞马国际	600	10,302.00	0.01
182	002130	沃尔核材	1,600	10,288.00	0.01
183	300152	科融环境	1,300	10,257.00	0.01
184	002313	日海通讯	500	10,255.00	0.01
185	002073	软控股份	1,200	10,176.00	0.01
186	300413	快乐购	500	10,145.00	0.01
187	300238	冠昊生物	400	10,140.00	0.01
188	002106	莱宝高科	1,000	10,130.00	0.01
189	300332	天壕环境	1,000	10,100.00	0.01
190	300212	易华录	400	10,092.00	0.01
191	300078	思创医惠	940	10,086.20	0.01
192	002413	雷科防务	900	10,080.00	0.01
193	002463	沪电股份	2,200	10,010.00	0.01
194	002222	福晶科技	700	9,989.00	0.01
195	002156	通富微电	980	9,976.40	0.01
196	002482	广田集团	1,100	9,889.00	0.01
197	002242	九阳股份	500	9,835.00	0.01
198	300036	超图软件	600	9,810.00	0.01
199	300101	振芯科技	700	9,800.00	0.01

200	002097	山河智能	1,100	9,779.00	0.01
201	002663	普邦股份	1,800	9,774.00	0.01
202	300012	华测检测	2,100	9,723.00	0.01
203	002148	北纬通信	900	9,693.00	0.01
204	002031	巨轮智能	3,100	9,641.00	0.01
205	002428	云南锗业	900	9,612.00	0.01
206	002253	川大智胜	400	9,600.00	0.01
206	300011	鼎汉技术	600	9,600.00	0.01
207	002690	美亚光电	500	9,590.00	0.01
208	300096	易联众	700	9,576.00	0.01
209	002371	北方华创	400	9,568.00	0.01
210	300327	中颖电子	300	9,510.00	0.01
211	300476	胜宏科技	400	9,452.00	0.01
212	002063	远光软件	900	9,378.00	0.01
213	002481	双塔食品	1,400	9,338.00	0.01
214	002085	万丰奥威	480	9,336.00	0.01
215	002099	海翔药业	1,400	9,324.00	0.01
216	002041	登海种业	700	9,275.00	0.01
217	002303	美盈森	1,200	9,264.00	0.01
218	300131	英唐智控	1,100	9,262.00	0.01
219	300147	香雪制药	900	9,243.00	0.01
220	002429	兆驰股份	3,000	9,210.00	0.01
221	300037	新宙邦	400	9,192.00	0.01
222	002707	众信旅游	700	9,191.00	0.01
223	300039	上海凯宝	1,260	9,160.20	0.01
224	002448	中原内配	900	9,117.00	0.01
225	300376	易事特	1,000	9,070.00	0.01
226	002005	德豪润达	1,900	9,063.00	0.01

227	002668	奥马电器	460	9,062.00	0.01
228	002277	友阿股份	1,400	9,030.00	0.01
229	300228	富瑞特装	800	9,008.00	0.01
230	002283	天润曲轴	1,400	8,960.00	0.01
231	300110	华仁药业	1,000	8,940.00	0.01
232	002091	江苏国泰	930	8,881.50	0.01
233	002224	三力士	800	8,880.00	0.01
233	002284	亚太股份	800	8,880.00	0.01
234	002649	博彦科技	800	8,824.00	0.01
235	002650	加加食品	1,500	8,820.00	0.01
236	300292	吴通控股	1,300	8,801.00	0.01
237	002256	兆新股份	2,000	8,780.00	0.01
238	300297	蓝盾股份	800	8,760.00	0.01
239	002467	二六三	1,100	8,712.00	0.01
240	002474	榕基软件	800	8,680.00	0.01
241	002251	步步高	700	8,673.00	0.01
242	300252	金信诺	400	8,660.00	0.01
243	002329	皇氏集团	900	8,649.00	0.01
244	300188	美亚柏科	500	8,645.00	0.01
245	002636	金安国纪	500	8,635.00	0.01
246	002695	煌上煌	400	8,544.00	0.01
247	300377	赢时胜	750	8,542.50	0.01
248	002094	青岛金王	400	8,532.00	0.01
249	002044	美年健康	500	8,500.00	0.01
250	002563	森马服饰	1,000	8,480.00	0.01
251	002215	诺普信	1,000	8,460.00	0.01
252	300032	金龙机电	600	8,370.00	0.01
253	300288	朗玛信息	300	8,355.00	0.01

254	002433	太安堂	900	8,325.00	0.01
255	002443	金洲管道	900	8,280.00	0.01
256	300202	聚龙股份	500	8,260.00	0.01
257	002052	同洲电子	1,300	8,242.00	0.01
258	300043	星辉娱乐	1,000	8,210.00	0.01
259	002572	索菲亚	200	8,200.00	0.01
260	300183	东软载波	400	8,192.00	0.01
261	002339	积成电子	600	8,184.00	0.01
262	002318	久立特材	1,000	8,180.00	0.01
262	002581	未名医药	400	8,180.00	0.01
263	002367	康力电梯	700	8,176.00	0.01
264	002161	远望谷	1,000	8,100.00	0.01
264	002504	*ST 弘高	1,000	8,100.00	0.01
265	002498	汉缆股份	2,200	8,052.00	0.01
266	002717	岭南园林	300	8,040.00	0.01
267	002600	江粉磁材	700	8,022.00	0.01
268	300269	联建光电	400	8,012.00	0.01
269	300034	钢研高纳	500	7,905.00	0.01
270	300458	全志科技	300	7,902.00	0.01
271	002249	大洋电机	1,200	7,896.00	0.01
272	300359	全通教育	600	7,842.00	0.01
273	002476	宝莫股份	1,000	7,800.00	0.01
274	300336	新文化	500	7,730.00	0.01
275	002445	中南文化	600	7,710.00	0.01
276	300178	腾邦国际	600	7,680.00	0.01
277	002670	国盛金控	480	7,632.00	0.01
278	300339	润和软件	600	7,560.00	0.01
279	002502	骅威文化	800	7,512.00	0.01

280	002344	海宁皮城	900	7,488.00	0.01
281	002721	金一文化	500	7,465.00	0.01
282	002269	美邦服饰	2,000	7,460.00	0.01
283	300128	锦富技术	886	7,442.40	0.01
284	002170	芭田股份	1,000	7,430.00	0.01
285	002751	易尚展示	200	7,410.00	0.01
286	002631	德尔未来	500	7,365.00	0.01
287	002727	一心堂	400	7,360.00	0.01
288	300031	宝通科技	400	7,356.00	0.01
289	002414	高德红外	400	7,320.00	0.01
290	300300	汉鼎宇佑	400	7,256.00	0.01
291	002180	纳思达	300	7,248.00	0.01
292	300302	同有科技	400	7,204.00	0.01
293	002699	美盛文化	520	7,176.00	0.01
294	300432	富临精工	300	7,170.00	0.01
295	300005	探路者	900	7,092.00	0.00
296	300474	景嘉微	200	7,080.00	0.00
297	002505	大康农业	2,010	7,035.00	0.00
298	002288	超华科技	1,000	6,970.00	0.00
299	300221	银禧科技	500	6,950.00	0.00
300	002488	金固股份	600	6,942.00	0.00
301	002588	史丹利	900	6,921.00	0.00
302	002279	久其软件	550	6,902.50	0.00
303	002577	雷柏科技	300	6,891.00	0.00
304	002364	中恒电气	500	6,845.00	0.00
305	002493	荣盛石化	700	6,832.00	0.00
306	002229	鸿博股份	600	6,720.00	0.00
307	002568	百润股份	400	6,648.00	0.00

308	300231	银信科技	500	6,600.00	0.00
309	002556	辉隆股份	900	6,561.00	0.00
310	300156	神雾环保	200	6,552.00	0.00
311	002298	中电鑫龙	600	6,522.00	0.00
312	002604	龙力生物	700	6,517.00	0.00
313	002203	海亮股份	800	6,512.00	0.00
314	002416	爱施德	600	6,474.00	0.00
315	002157	正邦科技	1,400	6,370.00	0.00
316	002092	中泰化学	500	6,350.00	0.00
317	300047	天源迪科	500	6,305.00	0.00
318	002782	可立克	300	6,285.00	0.00
319	300256	星星科技	600	6,240.00	0.00
320	002458	益生股份	300	6,195.00	0.00
321	002355	兴民智通	600	6,138.00	0.00
322	002539	云图控股	700	6,090.00	0.00
323	002314	南山控股	900	6,021.00	0.00
324	300379	东方通	300	5,880.00	0.00
325	300224	正海磁材	650	5,850.00	0.00
326	002619	巨龙管业	900	5,733.00	0.00
327	300506	名家汇	200	5,646.00	0.00
328	300369	绿盟科技	500	5,530.00	0.00
329	002703	浙江世宝	200	5,478.00	0.00
330	300386	飞天诚信	300	5,337.00	0.00
331	300465	高伟达	500	5,335.00	0.00
332	300191	潜能恒信	200	5,324.00	0.00
333	002128	露天煤业	600	5,220.00	0.00
334	002653	海思科	400	5,204.00	0.00
335	002655	共达电声	600	5,100.00	0.00

336	002418	康盛股份	500	4,655.00	0.00
337	300331	苏大维格	200	4,330.00	0.00
338	300368	汇金股份	300	4,314.00	0.00
339	002590	万安科技	300	4,203.00	0.00
340	002737	葵花药业	100	3,080.00	0.00
341	002786	银宝山新	200	2,916.00	0.00
342	002020	京新药业	200	2,370.00	0.00
343	300439	美康生物	100	2,150.00	0.00
344	300348	长亮科技	100	2,120.00	0.00
345	002118	紫鑫药业	300	2,049.00	0.00
346	002399	海普瑞	100	2,023.00	0.00
347	002496	辉丰股份	400	1,984.00	0.00
348	002471	中超控股	400	1,956.00	0.00
349	300295	三六五网	100	1,871.00	0.00
350	300006	莱美药业	280	1,814.40	0.00
351	002111	威海广泰	100	1,813.00	0.00
352	002550	千红制药	300	1,782.00	0.00
353	002093	国脉科技	200	1,760.00	0.00
354	002267	陕天然气	200	1,758.00	0.00
355	002369	卓翼科技	200	1,728.00	0.00
356	002177	御银股份	300	1,704.00	0.00
357	300048	合康新能	320	1,680.00	0.00
358	300066	三川智慧	300	1,662.00	0.00
359	002551	尚荣医疗	100	1,613.00	0.00
360	002480	新筑股份	200	1,586.00	0.00
361	002741	光华科技	100	1,564.00	0.00
362	300392	腾信股份	100	1,538.00	0.00
363	300016	北陆药业	100	1,524.00	0.00

364	002533	金杯电工	200	1,512.00	0.00
365	002609	捷顺科技	100	1,497.00	0.00
366	002702	海欣食品	180	1,488.60	0.00
367	002079	苏州固锔	200	1,474.00	0.00
368	300245	天玑科技	100	1,395.00	0.00
369	002446	盛路通信	110	1,338.70	0.00
370	002197	证通电子	100	1,256.00	0.00
371	300333	兆日科技	100	1,254.00	0.00
372	002309	中利集团	100	1,251.00	0.00
373	300229	拓尔思	100	1,237.00	0.00
374	002235	安妮股份	100	1,220.00	0.00
375	300004	南风股份	100	1,201.00	0.00
376	002698	博实股份	100	1,177.00	0.00
377	002240	威华股份	100	1,175.00	0.00
378	300171	东富龙	100	1,169.00	0.00
379	002432	九安医疗	100	1,153.00	0.00
380	300177	中海达	100	1,137.00	0.00
381	002296	辉煌科技	100	1,078.00	0.00
382	300045	华力创通	100	1,020.00	0.00
383	300307	慈星股份	100	1,012.00	0.00
384	002378	章源钨业	100	905.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300136	信维通信	246,063.00	0.16

2	002508	老板电器	179,047.98	0.12
3	002044	美年健康	176,782.00	0.12
4	002085	万丰奥威	160,826.00	0.11
5	002572	索菲亚	155,887.29	0.10
6	300156	神雾环保	152,802.51	0.10
7	002092	中泰化学	144,840.00	0.10
8	300296	利亚德	144,587.00	0.09
9	002271	东方雨虹	141,240.00	0.09
10	300115	长盈精密	134,800.00	0.09
11	300142	沃森生物	120,338.00	0.08
12	002185	华天科技	115,850.00	0.08
13	300159	新研股份	115,819.00	0.08
14	002311	海大集团	109,095.00	0.07
15	300015	爱尔眼科	108,645.00	0.07
16	002221	东华能源	107,055.00	0.07
17	300145	中金环境	105,854.00	0.07
18	002366	台海核电	105,483.00	0.07
19	002491	通鼎互联	105,333.00	0.07
20	300197	铁汉生态	103,907.00	0.07

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	300136	信维通信	267,858.00	0.18
2	002508	老板电器	194,606.05	0.13
3	002044	美年健康	188,278.00	0.12
4	300156	神雾环保	180,776.50	0.12

5	002572	索菲亚	180,349.00	0.12
6	002085	万丰奥威	170,713.00	0.11
7	002092	中泰化学	157,272.00	0.10
8	002271	东方雨虹	138,009.00	0.09
9	300296	利亚德	132,476.00	0.09
10	300115	长盈精密	125,033.80	0.08
11	002491	通鼎互联	120,827.00	0.08
12	300142	沃森生物	113,253.00	0.07
13	002185	华天科技	108,251.60	0.07
14	300159	新研股份	101,486.00	0.07
15	300015	爱尔眼科	101,401.00	0.07
16	002221	东华能源	100,845.00	0.07
17	002311	海大集团	99,593.00	0.07
18	002366	台海核电	96,948.00	0.06
19	002131	利欧股份	96,923.03	0.06
20	002665	首航节能	94,829.40	0.06

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	20,162,771.27
卖出股票收入（成交）总额	19,455,283.52

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

7.10 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	嘉实中创 400ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	131,055,301.52	91.83

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	12,743.23
2	应收证券清算款	430,310.19

3	应收股利	-
4	应收利息	1,414.28
5	应收申购款	81,229.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	525,696.82

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	300088	长信科技	45,675.00	0.03	重大事项停牌
2	002075	沙钢股份	41,912.00	0.03	重大事项停牌
3	002622	融钰集团	31,980.00	0.02	重大事项停牌
4	002168	深圳惠程	27,184.00	0.02	重大事项停牌
5	300291	华录百纳	26,026.00	0.02	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6,980	11,630.93	-	-	81,183,898.02	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	20,628.62	0.03%

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	80,675,757.79
本报告期基金总申购份额	23,731,357.14
减：本报告期基金总赎回份额	23,223,216.91
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	81,183,898.02

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

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
国泰君安证 券股份有限 公司	2	39,618,054.79	100.00%	36,897.02	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 券有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
长城证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 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	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股	1	-	-	-	-	新增

份有限公司						
西藏东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增

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。

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	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
国泰君安证券股份有限公司	934.88	100.00%	-	-	-	-	115,747.25	100.00%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于调整凤凰金信基金代销的部分开放式基金转换补差费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 2 月 28 日
2	关于增加植信基金为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 3 月 16 日
3	增加方正证券为嘉实旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 3 月 27 日
4	关于嘉实旗下部分开放式基金转换业务更新的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 4 月 12 日
5	关于增加创金启富为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 4 月 14 日
6	嘉实基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 4 月 28 日
7	关于增加北京肯特瑞为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 5 月 31 日
8	关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换起点及账户最低持有份额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 6 月 28 日
9	关于增加中民财富为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
- (2) 《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

11.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日