

# 嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2019 年半年度报告

2019 年 06 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：2019 年 08 月 29 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 2019 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51

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 .....	51
7.10 期末投资目标基金明细 .....	51
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.13 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
11.1 备查文件目录 .....	59
11.2 存放地点 .....	59
11.3 查阅方式 .....	59

## § 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	102,176,035.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实中创 400ETF 联接 A	嘉实中创 400ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	070030	005727
报告期末下属分级基金的份 额总额	93,880,903.64 份	8,295,132.33 份

#### 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%，年化跟踪误差不得超过 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)65215588	(010)66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 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		经雷	陈四清

### 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
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(2019年01月01日-2019年06月30日)		
	嘉实中创 400ETF 联接 A	嘉实中创 400ETF 联接 C	
本期已实现收益	-7,530,326.73	-405,312.26	
本期利润	17,596,135.56	1,775,154.70	
加权平均基金份额本期利润	0.1836	0.1924	
本期加权平均净值利润率	14.11%	23.74%	
本期基金份额净值增长率	16.71%	16.42%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)		
	期末可供分配利润	26,320,359.42	-1,838,290.85
	期末可供分配基金份额利润	0.2804	-0.2216
	期末基金资产净值	120,201,263.06	6,456,841.48
	期末基金份额净值	1.2804	0.7784
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)		
	基金份额累计净值增长率	28.04%	-22.16%

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) 2018年3月2日本基金管理人发布“关于嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联

接基金增设 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告”，自 2018 年 3 月 6 日起，对本基金增设 C 类基金份额，并对本基金的基金合同和托管协议及相关法律文件做出相应修改；（4）嘉实中创 400ETF 联接 A 收取认（申）购费和赎回费，嘉实中创 400ETF 联接 C 不收取认（申）购费但收取赎回费、计提销售服务费；（5）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

嘉实中创 400ETF 联接 A

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	0.32%	1.49%	0.25%	1.50%	0.07%	-0.01%
过去三个月	-11.16%	1.85%	-11.41%	1.86%	0.25%	-0.01%
过去六个月	16.71%	1.82%	16.89%	1.83%	-0.18%	-0.01%
过去一年	-8.77%	1.69%	-8.99%	1.69%	0.22%	0.00%
过去三年	-36.97%	1.31%	-35.63%	1.31%	-1.34%	0.00%
自基金合同生效起至今	28.04%	1.68%	43.47%	1.72%	-15.43%	-0.04%

嘉实中创 400ETF 联接 C

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	0.28%	1.49%	0.25%	1.50%	0.03%	-0.01%
过去三个月	-11.29%	1.85%	-11.41%	1.86%	0.12%	-0.01%
过去六个月	16.42%	1.82%	16.89%	1.83%	-0.47%	-0.01%
过去一年	-9.16%	1.69%	-8.99%	1.69%	-0.17%	0.00%
自基金合同生效起至今	-22.16%	1.63%	-22.11%	1.64%	-0.05%	-0.01%

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A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**

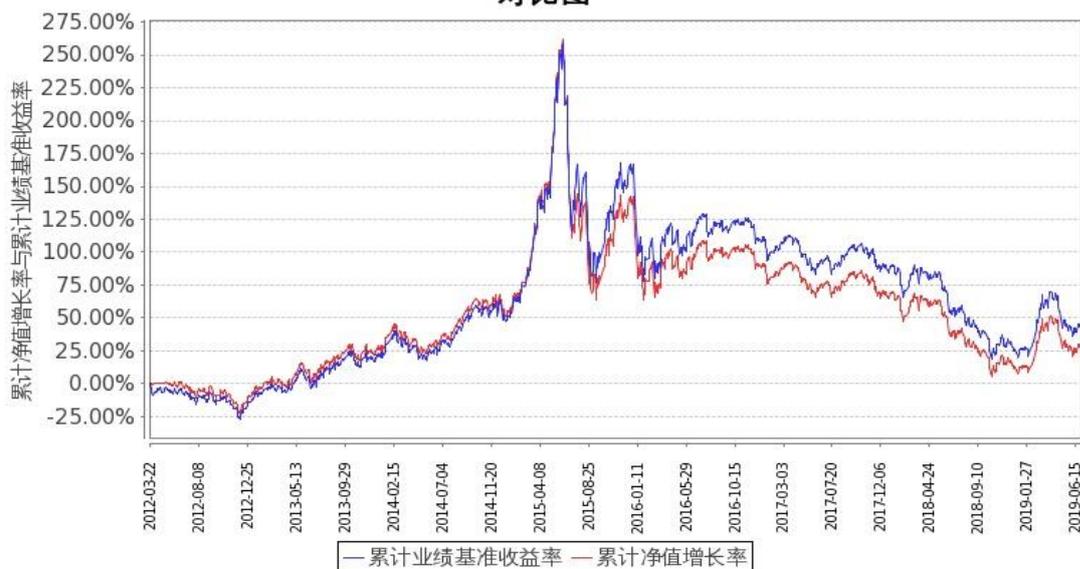


图 1：嘉实中创 400ETF 联接 A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 3 月 22 日至 2019 年 6 月 30 日)

**嘉实中创400ETF联接C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**

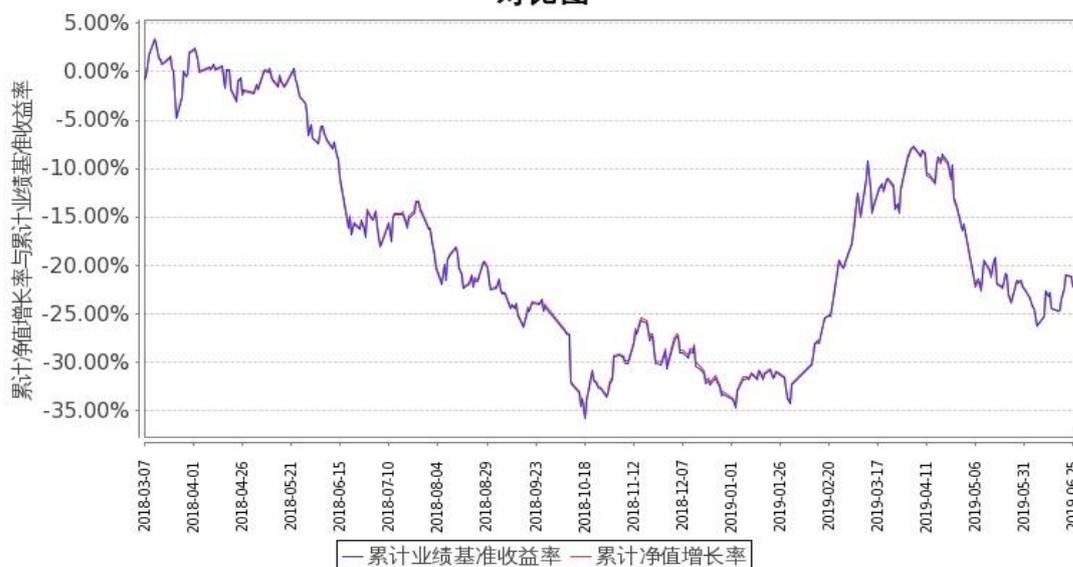


图 2: 嘉实中创 400ETF 联接 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 3 月 7 日至 2019 年 6 月 30 日)

注: 1. 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。

2. 2019 年 3 月 30 日, 本基金管理人发布《关于嘉实中创 400ETF 联接基金经理变更的公告》, 增聘李直先生担任本基金基金经理职务, 与基金经理刘珈吟女士共同管理本基金。陈正宪先生不再担任本基金基金经理职务。

## § 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、北京怀柔、武汉设有分公司。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 2019 年 6 月 30 日, 基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、154 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（QDII）混合、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）、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 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 A/E、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、嘉实快线货币、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、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、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、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、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、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、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、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生

港股通新经济指数（LOF）、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合（FOF）、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合（FOF）、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还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		
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、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）基金经理	2016 年 3 月 24 日	-	10 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。
李直	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 基金经理	2019 年 3 月 30 日	-	4 年	2014 年 7 月加入嘉实基金，从事指数基金投资研究工作。硕士研究生，具有基金从业资格。
陈正宪	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、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、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实基本面 50ETF 基金经理	2016 年 3 月 24 日	2019 年 3 月 30 日	14 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。

注：（1）任职日期、离任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 4 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 0.35%。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

截至本报告期末嘉实中创 400ETF 联接 A 基金份额净值为 1.2804 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.71%；截至本报告期末嘉实中创 400ETF 联接 C 基金份额净值为 0.7784 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.42%；业绩比较基准收益率为 16.89%。

## 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，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但不限于上海、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) 根据嘉实中创 400ETF 联接 C 本报告 3.1.2 “期末可供分配利润”为-1,838,290.85 元，以及本基金基金合同（十五（三）基金收益分配原则）的约定，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 2019 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,839,612.27	6,349,218.75
结算备付金		96,894.94	14,329.47
存出保证金		26,080.08	11,765.38
交易性金融资产	6.4.7.2	120,088,254.61	105,769,314.15
其中：股票投资		4,604,276.68	3,296,667.21
基金投资		115,483,177.93	102,472,646.94
债券投资		800.00	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,267.78	1,277.48
应收股利		-	-
应收申购款		39,647.50	218,700.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		127,091,757.18	112,364,605.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	239,088.43
应付赎回款		296,647.67	105,199.61
应付管理人报酬		4,530.17	4,272.64
应付托管费		906.05	854.54
应付销售服务费		2,047.49	1,174.45
应付交易费用	6.4.7.7	47,257.28	18,143.45
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	82,263.98	200,290.64
负债合计		433,652.64	569,023.76
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	102,176,035.97	104,045,824.87
未分配利润	6.4.7.10	24,482,068.57	7,749,757.00
所有者权益合计		126,658,104.54	111,795,581.87
负债和所有者权益总计		127,091,757.18	112,364,605.63

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，嘉实中创 400ETF 联接 A 基金份额净值 1.2804 元，基金份额总额 93,880,903.64 份；嘉实中创 400ETF 联接 C 基金份额净值 0.7784 元，基金份额总额 8,295,132.33 份。基金份额总额合计为 102,176,035.97 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		19,656,464.57	-19,603,493.03
1. 利息收入		28,578.07	25,440.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	28,576.74	25,438.62
债券利息收入		1.33	2.25
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）		-7,824,301.79	-3,266,590.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	191,707.80	-583,963.58
基金投资收益	6.4.7.13	-8,042,168.16	-2,704,432.43
债券投资收益	6.4.7.14	759.08	977.31

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	25,399.49	20,828.12
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	27,306,929.25	-16,406,930.93
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	145,259.04	44,587.61
减：二、费用		285,174.31	201,290.59
1. 管理人报酬		26,692.06	27,148.48
2. 托管费		5,338.48	5,429.73
3. 销售服务费		14,495.31	1,513.92
4. 交易费用	6.4.7.19	154,882.65	66,931.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	83,765.81	100,267.03
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		19,371,290.26	-19,804,783.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		19,371,290.26	-19,804,783.62

### 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	104,045,824.87	7,749,757.00	111,795,581.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,371,290.26	19,371,290.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,869,788.90	-2,638,978.69	-4,508,767.59

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	85,239,305.42	15,145,248.21	100,384,553.63
2. 基金赎回款	-87,109,094.32	-17,784,226.90	-104,893,321.22
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)	102,176,035.97	24,482,068.57	126,658,104.54
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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)	71,246,824.10	47,077,913.00	118,324,737.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-19,804,783.62	-19,804,783.62
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)	8,903,914.90	3,443,043.09	12,346,957.99
其中：1. 基金申购款	37,861,042.73	19,536,105.49	57,397,148.22
2. 基金赎回款	-28,957,127.83	-16,093,062.40	-45,050,190.23
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)	80,150,739.00	30,716,172.47	110,866,911.47

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：

经雷

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。

根据《嘉实基金管理有限公司关于嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金增设 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告》,自 2018 年 3 月 6 日起,对本基金增加 C 类基金份额类别,本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金 A 类基金份额。本基金根据所收取费用的差异,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购基金时收取申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类基金资产中计提销售服务费,并不收取申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金两类基金份额分别设置代码,分别公布基金份额净值和基金份额累计净值。

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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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[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》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	6,839,612.27
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月及以上	-
其他存款	-
合计	6,839,612.27

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 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,604,707.95	4,604,276.68	-431.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	800.00	800.00
	银行间市场	-	-
	合计	800.00	800.00
资产支持证券	-	-	-
基金	150,441,511.96	115,483,177.93	-34,958,334.03
其他	-	-	-
合计	155,047,019.91	120,088,254.61	-34,958,765.30

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(2019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(2019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(2019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 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,217.82
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	39.24
应收债券利息	0.19
应收资产支持证券利息	-
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	10.53
合计	1,267.78

#### 6.4.7.6 其他资产

本期末（2019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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	47,257.28
银行间市场应付交易费用	-
合计	47,257.28

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	224.88
预提费用	82,039.10
合计	82,263.98

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 嘉实中创 400ETF 联接 A

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,564,819.45	98,564,819.45
本期申购	56,320,983.73	56,320,983.73
本期赎回（以“-”号填列）	-61,004,899.54	-61,004,899.54
本期末	93,880,903.64	93,880,903.64

##### 嘉实中创 400ETF 联接 C

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,481,005.42	5,481,005.42
本期申购	28,918,321.69	28,918,321.69
本期赎回（以“-”号填列）	-26,104,194.78	-26,104,194.78
本期末	8,295,132.33	8,295,132.33

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。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实中创 400ETF 联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	44,461,480.22	-34,895,391.74	9,566,088.48
本期利润	-7,530,326.73	25,126,462.29	17,596,135.56
本期基金份额 交易产生的变 动数	-2,036,011.80	1,194,147.18	-841,864.62
其中：基金申 购款	23,267,978.95	-2,657,883.24	20,610,095.71
基金赎 回款	-25,303,990.75	3,852,030.42	-21,451,960.33
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	34,895,141.69	-8,574,782.27	26,320,359.42
嘉实中创 400ETF 联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-179,125.19	-1,637,206.29	-1,816,331.48
本期利润	-405,312.26	2,180,466.96	1,775,154.70
本期基金份额 交易产生的变 动数	-103,963.57	-1,693,150.50	-1,797,114.07
其中：基金申 购款	-1,492,046.52	-3,972,800.98	-5,464,847.50
基金赎 回款	1,388,082.95	2,279,650.48	3,667,733.43
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	-688,401.02	-1,149,889.83	-1,838,290.85

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	26,740.53
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	827.70
其他	1,008.51
合计	28,576.74

## 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 2019年1月1日至 2019年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-170,178.31
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	361,886.11
合计	191,707.80

## 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 2019年1月1日至 2019年6月30日
卖出股票成交总额	51,793,035.45
减：卖出股票成本总额	51,963,213.76
买卖股票差价收入	-170,178.31

## 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 2019年1月1日至 2019年6月30日
申购基金份额总额	31,661,100.00
减：现金支付申购款总额	-900,474.83
减：申购股票成本总额	32,199,688.72
申购差价收入	361,886.11

## 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	37,784,055.11
减：卖出/赎回基金成本总额	45,826,223.27
减：基金投资收益应缴纳增值税额	-
基金投资收益	-8,042,168.16

## 6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,660.22
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,900.00
减：应收利息总额	1.14
买卖债券差价收入	759.08

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本期（2019年1月1日至2019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
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	25,399.49
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,399.49

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	27,306,929.25
股票投资	135,762.87
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	27,171,166.38
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值 税	-
合计	27,306,929.25

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	47,055.59
基金转出费收入	98,203.45
债券认购手续费返还	-

印花税手续费返还	-
其他	-
合计	145,259.04

#### 6.4.7.19 交易费用

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	153,025.87
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	1,856.78
其中：申购费	845.14
赎回费	958.06
交易费	53.58
合计	154,882.65

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	57,243.91
银行划款手续费	1,726.71
合计	83,765.81

#### 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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 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 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	26,692.06	27,148.48
其中：支付销售机构的客户维护费	63,291.52	61,663.44

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。

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 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,338.48	5,429.73

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。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实中创 400ETF 联接 A	嘉实中创 400ETF 联接 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	11,943.33	11,943.33
中国工商银行	-	-	-
合计	-	11,943.33	11,943.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实中创 400ETF 联接 A	嘉实中创 400ETF 联接 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	1,055.17	1,055.17
中国工商银行	-	-	-
合计	-	1,055.17	1,055.17

注：（1）本基金 C 类份额销售服务费年费率为 0.40%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 0.40% / 当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

## 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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 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自有资金投资本基金的情况

本报告期内（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），基金管理人未运用自有资金申购、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（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中国工商银行股份有限公司_活期	6,839,612.27	26,740.53	5,816,927.39	24,137.39

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,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(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1日至2018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(2019年6月30日),本基金持有86,187,908.00份目标ETF基金份额(2018年12月31日:89,990,908.00份),占其总份额的比例为95.17%(2018年12月31日:95.17%)。

#### 6.4.11 利润分配情况

本期(2019年1月1日至2019年6月30日),本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末(2019年06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

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128068	和而转债	2019年6月4日	2019年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	8	800.00	800.00	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末(2019年6月30日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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(2019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(2019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。

本基金债券投资、资产支持证券投资、同业存单投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	800.00	-
未评级	-	-
合计	800.00	-

注：1. 上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按长期信用评级的债券投资。2. 长期信用评

级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### **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。

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。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评

估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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 2019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	6,839,612.27	-	-	-	6,839,612.27

结算备付金	96,894.94	-	-	-	96,894.94
存出保证金	26,080.08	-	-	-	26,080.08
交易性金融资产	-	-	800.00	120,087,454.61	120,088,254.61
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	-	-	-	1,267.78	1,267.78
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	14,337.45	-	-	25,310.05	39,647.50
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,976,924.74	-	800.00	120,114,032.44	127,091,757.18
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	-	-	-	296,647.67	296,647.67
应付管理人报酬	-	-	-	4,530.17	4,530.17
应付托管费	-	-	-	906.05	906.05
应付销售服务费	-	-	-	2,047.49	2,047.49
应付交易费用	-	-	-	47,257.28	47,257.28
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	82,263.98	82,263.98
负债总计	-	-	-	433,652.64	433,652.64
利率敏感度缺口	6,976,924.74	-	800.00	119,680,379.80	126,658,104.54
上年度末 2018 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	6,349,218.75	-	-	-	6,349,218.75
结算备付金	14,329.47	-	-	-	14,329.47
存出保证金	11,765.38	-	-	-	11,765.38
交易性金融资产	-	-	-	105,769,314.15	105,769,314.15
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	-	-	-	1,277.48	1,277.48
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	89,319.33	-	-	129,381.07	218,700.40

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,464,632.93	-	-	105,899,972.70	112,364,605.63
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	-	-	-	239,088.43	239,088.43
应付赎回款	-	-	-	105,199.61	105,199.61
应付管理人报酬	-	-	-	4,272.64	4,272.64
应付托管费	-	-	-	854.54	854.54
应付销售服务费	-	-	-	1,174.45	1,174.45
应付交易费用	-	-	-	18,143.45	18,143.45
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	200,290.64	200,290.64
负债总计	-	-	-	569,023.76	569,023.76
利率敏感度缺口	6,464,632.93	-	-	-105,330,948.94	111,795,581.87

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 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%（2018 年 12 月 31 日：无）。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018 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 2019年6月30日		上年度末 2018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	4,604,276.68	3.64	3,296,667.21	2.95
交易性金融资产—基金投资	115,483,177.93	91.18	102,472,646.94	91.66
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	120,087,454.61	94.81	105,769,314.15	94.61

#### 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		
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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升5%	6,300,474.68	5,566,352.43
	业绩比较基准下降	-6,300,474.68	-5,566,352.43

	5%		
--	----	--	--

#### 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 120,087,454.61 元，属于第二层次的余额为 800.00 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 105,756,789.15 元，第二层次 12,525.00 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,604,276.68	3.62
	其中：股票	4,604,276.68	3.62
2	基金投资	115,483,177.93	90.87
3	固定收益投资	800.00	0.00
	其中：债券	800.00	0.00
	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	6,936,507.21	5.46
8	其他各项资产	66,995.36	0.05
9	合计	127,091,757.18	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	44,026.40	0.03
B	采矿业	38,894.00	0.03
C	制造业	3,138,302.28	2.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,874.00	0.01
E	建筑业	64,900.40	0.05
F	批发和零售业	120,670.50	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	14,846.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	775,677.90	0.61
J	金融业	71,067.00	0.06
K	房地产业	32,174.00	0.03
L	租赁和商务服务业	98,258.20	0.08
M	科学研究和技术服务业	59,881.40	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	66,702.40	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	5,755.20	0.00
Q	卫生和社会工作	13,584.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	50,663.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	4,604,276.68	3.64

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002157	正邦科技	2,800	46,648.00	0.04
2	002127	南极电商	3,650	41,026.00	0.03
3	002463	沪电股份	2,600	35,412.00	0.03
4	300450	先导智能	999	33,566.40	0.03
5	002507	涪陵榨菜	1,100	33,550.00	0.03
6	002384	东山精密	2,250	32,782.50	0.03
7	300012	华测检测	3,000	32,400.00	0.03
8	002555	三七互娱	2,300	31,165.00	0.02
9	002385	大北农	5,700	30,153.00	0.02
10	002821	凯莱英	300	29,424.00	0.02
11	002506	协鑫集成	4,300	28,724.00	0.02
12	002268	卫士通	1,160	28,362.00	0.02
13	002926	华西证券	2,700	28,350.00	0.02
14	300168	万达信息	2,000	25,940.00	0.02
15	002373	千方科技	1,500	25,650.00	0.02
16	002353	杰瑞股份	1,100	25,410.00	0.02
17	300207	欣旺达	2,200	25,344.00	0.02
18	002387	维信诺	1,900	24,795.00	0.02
19	300271	华宇软件	1,298	24,662.00	0.02
20	002138	顺络电子	1,400	24,612.00	0.02
21	300285	国瓷材料	1,400	23,814.00	0.02
22	002191	劲嘉股份	1,900	23,579.00	0.02
23	002299	圣农发展	900	22,788.00	0.02
24	300009	安科生物	1,432	22,768.80	0.02
25	002075	沙钢股份	2,900	22,736.00	0.02
26	002217	合力泰	4,100	22,673.00	0.02
27	300226	上海钢联	300	22,488.00	0.02
28	002916	深南电路	220	22,422.40	0.02
29	300088	长信科技	4,300	21,758.00	0.02
30	300628	亿联网络	200	21,414.00	0.02
31	300166	东方国信	1,740	21,384.60	0.02

32	002281	光迅科技	800	21,184.00	0.02
33	300098	高新兴	2,648	21,131.04	0.02
34	002078	太阳纸业	3,100	21,111.00	0.02
35	300170	汉得信息	1,500	20,385.00	0.02
36	002180	纳思达	900	20,340.00	0.02
37	002131	利欧股份	10,600	20,246.00	0.02
38	002237	恒邦股份	1,200	20,052.00	0.02
39	300001	特锐德	1,100	19,822.00	0.02
40	300315	掌趣科技	5,700	19,665.00	0.02
41	300274	阳光电源	2,100	19,635.00	0.02
42	002019	亿帆医药	1,600	19,600.00	0.02
43	002185	华天科技	3,800	19,342.00	0.02
44	002002	鸿达兴业	3,100	19,189.00	0.02
45	300529	健帆生物	300	18,705.00	0.01
46	300027	华谊兄弟	3,800	18,658.00	0.01
47	002152	广电运通	2,700	18,495.00	0.01
48	002511	中顺洁柔	1,500	18,420.00	0.01
49	002372	伟星新材	1,056	18,374.40	0.01
50	002035	华帝股份	1,500	18,270.00	0.01
51	002396	星网锐捷	800	17,952.00	0.01
52	002212	南洋股份	1,300	17,810.00	0.01
53	002233	塔牌集团	1,500	17,520.00	0.01
54	002273	水晶光电	1,500	17,370.00	0.01
55	300182	捷成股份	3,900	17,199.00	0.01
56	002155	湖南黄金	1,700	17,119.00	0.01
57	002266	浙富控股	3,600	17,100.00	0.01
58	300357	我武生物	504	17,095.68	0.01
59	300058	蓝色光标	4,000	17,080.00	0.01
60	300212	易华录	696	17,052.00	0.01
61	002436	兴森科技	2,600	17,030.00	0.01
62	002004	华邦健康	3,500	17,010.00	0.01
63	002123	梦网集团	1,200	16,968.00	0.01
64	002174	游族网络	1,000	16,880.00	0.01
65	002440	闰土股份	1,350	16,821.00	0.01
66	002595	豪迈科技	800	16,808.00	0.01
67	300188	美亚柏科	940	16,760.20	0.01
68	300316	晶盛机电	1,310	16,623.90	0.01
69	300558	贝达药业	400	16,600.00	0.01
70	300180	华峰超纤	1,180	16,543.60	0.01
71	002589	瑞康医药	2,150	16,318.50	0.01
72	002690	美亚光电	500	16,300.00	0.01
73	002773	康弘药业	490	16,130.80	0.01

74	300073	当升科技	700	16,079.00	0.01
75	002583	海能达	1,900	15,941.00	0.01
76	300079	数码科技	2,800	15,932.00	0.01
77	002023	海特高新	1,300	15,912.00	0.01
78	300352	北信源	2,550	15,733.50	0.01
79	300699	光威复材	480	15,696.00	0.01
80	002099	海翔药业	2,200	15,620.00	0.01
81	300339	润和软件	1,100	15,510.00	0.01
82	300038	数知科技	1,640	15,350.40	0.01
83	002183	怡亚通	3,200	15,264.00	0.01
84	002368	太极股份	500	15,150.00	0.01
85	002557	洽洽食品	600	15,150.00	0.01
86	002610	爱康科技	8,100	15,147.00	0.01
87	300463	迈克生物	600	15,078.00	0.01
88	002648	卫星石化	1,000	14,880.00	0.01
89	300133	华策影视	2,200	14,806.00	0.01
90	002449	国星光电	1,110	14,740.80	0.01
91	002399	海普瑞	700	14,693.00	0.01
92	300496	中科创达	500	14,540.00	0.01
93	002701	奥瑞金	3,100	14,477.00	0.01
94	300630	普利制药	250	14,405.00	0.01
95	300203	聚光科技	600	14,340.00	0.01
96	002727	一心堂	500	14,245.00	0.01
97	002407	多氟多	1,200	14,208.00	0.01
98	002640	跨境通	1,700	14,161.00	0.01
99	300113	顺网科技	900	14,112.00	0.01
100	300010	立思辰	1,500	14,085.00	0.01
101	002670	国盛金控	1,115	14,049.00	0.01
102	002812	恩捷股份	300	14,025.00	0.01
103	002408	齐翔腾达	1,800	13,950.00	0.01
104	002151	北斗星通	600	13,938.00	0.01
105	002020	京新药业	1,200	13,824.00	0.01
106	002080	中材科技	1,524	13,807.44	0.01
107	002042	华孚时尚	1,900	13,794.00	0.01
108	002176	江特电机	2,800	13,636.00	0.01
109	300244	迪安诊断	800	13,584.00	0.01
110	002665	首航节能	4,000	13,560.00	0.01
111	300595	欧普康视	380	13,528.00	0.01
112	002547	春兴精工	1,200	13,464.00	0.01
113	300026	红日药业	3,900	13,455.00	0.01
114	300451	创业慧康	900	13,455.00	0.01
115	002563	森马服饰	1,200	13,272.00	0.01

116	002402	和而泰	1,400	13,258.00	0.01
117	300567	精测电子	250	13,130.00	0.01
118	300053	欧比特	1,300	12,974.00	0.01
119	002491	通鼎互联	1,600	12,944.00	0.01
120	002056	横店东磁	1,700	12,920.00	0.01
121	002030	达安基因	1,200	12,876.00	0.01
122	300369	绿盟科技	1,000	12,810.00	0.01
123	002426	胜利精密	5,000	12,800.00	0.01
124	002597	金禾实业	700	12,768.00	0.01
125	002603	以岭药业	1,100	12,738.00	0.01
126	300002	神州泰岳	3,200	12,736.00	0.01
127	300292	吴通控股	2,100	12,600.00	0.01
128	300115	长盈精密	1,200	12,588.00	0.01
129	002497	雅化集团	1,800	12,582.00	0.01
130	002458	益生股份	640	12,486.40	0.01
131	002414	高德红外	650	12,480.00	0.01
132	300457	赢合科技	500	12,465.00	0.01
133	002244	滨江集团	3,000	12,450.00	0.01
134	002446	盛路通信	1,300	12,389.00	0.01
135	002302	西部建设	1,100	12,254.00	0.01
136	300294	博雅生物	450	12,217.50	0.01
137	300118	东方日升	1,200	12,216.00	0.01
138	002063	远光软件	1,400	12,194.00	0.01
139	002025	航天电器	500	12,190.00	0.01
140	002249	大洋电机	2,800	12,152.00	0.01
141	002262	恩华药业	1,120	12,084.80	0.01
142	002531	天顺风能	2,000	12,080.00	0.01
143	002064	华峰氨纶	2,400	12,048.00	0.01
144	300618	寒锐钴业	200	12,000.00	0.01
145	002444	巨星科技	1,200	11,976.00	0.01
146	002376	新北洋	1,000	11,950.00	0.01
147	002126	银轮股份	1,600	11,904.00	0.01
148	300197	铁汉生态	3,300	11,847.00	0.01
149	300284	苏交科	1,280	11,814.40	0.01
150	002925	盈趣科技	300	11,703.00	0.01
151	002051	中工国际	1,020	11,699.40	0.01
152	002488	金固股份	1,400	11,662.00	0.01
153	300078	思创医惠	1,140	11,639.40	0.01
154	002643	万润股份	1,150	11,615.00	0.01
155	300324	旋极信息	2,004	11,603.16	0.01
156	002390	信邦制药	2,200	11,594.00	0.01
157	002567	唐人神	1,000	11,550.00	0.01

158	002168	惠程科技	1,300	11,505.00	0.01
159	300054	鼎龙股份	1,440	11,448.00	0.01
160	002383	合众思壮	1,000	11,360.00	0.01
161	300367	东方网力	1,150	11,350.50	0.01
162	300482	万孚生物	300	11,310.00	0.01
163	300068	南都电源	1,000	11,300.00	0.01
164	300145	中金环境	2,600	11,284.00	0.01
165	002573	清新环境	1,400	11,270.00	0.01
166	002839	张家港行	2,000	11,260.00	0.01
167	002505	大康农业	5,710	11,248.70	0.01
168	002128	露天煤业	1,300	11,245.00	0.01
169	002419	天虹股份	850	11,101.00	0.01
170	002317	众生药业	1,300	11,063.00	0.01
171	300185	通裕重工	5,700	11,058.00	0.01
172	002280	联络互动	3,000	10,980.00	0.01
173	002028	思源电气	1,100	10,956.00	0.01
174	002130	沃尔核材	2,100	10,941.00	0.01
175	002675	东诚药业	1,000	10,920.00	0.01
176	002413	雷科防务	1,700	10,863.00	0.01
177	300326	凯利泰	1,200	10,860.00	0.01
178	002716	金贵银业	1,390	10,842.00	0.01
179	002285	世联行	2,400	10,824.00	0.01
180	002048	宁波华翔	1,000	10,820.00	0.01
181	002203	海亮股份	1,000	10,820.00	0.01
182	002421	达实智能	2,900	10,817.00	0.01
183	002332	仙琚制药	1,600	10,816.00	0.01
184	002717	岭南股份	2,135	10,760.40	0.01
185	300377	赢时胜	950	10,754.00	0.01
186	002831	裕同科技	560	10,735.20	0.01
187	002618	丹邦科技	800	10,728.00	0.01
188	300349	金卡智能	600	10,668.00	0.01
189	300355	蒙草生态	2,600	10,660.00	0.01
190	002683	宏大爆破	900	10,530.00	0.01
191	002073	软控股份	1,800	10,512.00	0.01
192	002596	海南瑞泽	1,300	10,504.00	0.01
193	300159	新研股份	2,100	10,458.00	0.01
194	002657	中科金财	600	10,440.00	0.01
195	300037	新宙邦	500	10,420.00	0.01
196	300310	宜通世纪	1,400	10,416.00	0.01
197	002242	九阳股份	500	10,405.00	0.01
198	300036	超图软件	700	10,346.00	0.01
199	002366	台海核电	1,100	10,296.00	0.01

200	002807	江阴银行	2,200	10,296.00	0.01
201	002093	国脉科技	1,100	10,219.00	0.01
202	002139	拓邦股份	1,750	10,150.00	0.01
203	002358	森源电气	1,000	10,150.00	0.01
204	002118	紫鑫药业	1,500	10,110.00	0.01
205	300199	翰宇药业	1,100	10,087.00	0.01
206	002389	航天彩虹	900	10,044.00	0.01
207	300055	万邦达	1,400	9,982.00	0.01
208	300085	银之杰	700	9,933.00	0.01
209	300287	飞利信	2,500	9,925.00	0.01
210	002145	中核钛白	2,400	9,912.00	0.01
211	002851	麦格米特	500	9,885.00	0.01
212	002091	江苏国泰	1,730	9,878.30	0.01
213	002429	兆驰股份	3,600	9,864.00	0.01
214	002537	海联金汇	1,300	9,802.00	0.01
215	002614	奥佳华	600	9,792.00	0.01
216	002261	拓维信息	1,600	9,776.00	0.01
217	002709	天赐材料	400	9,680.00	0.01
218	002430	杭氧股份	800	9,648.00	0.01
219	300130	新国都	600	9,540.00	0.01
220	002400	省广集团	3,200	9,536.00	0.01
221	002832	比音勒芬	200	9,534.00	0.01
222	002254	泰和新材	900	9,522.00	0.01
223	300308	中际旭创	280	9,517.20	0.01
224	002036	联创电子	1,040	9,516.00	0.01
225	300232	洲明科技	980	9,486.40	0.01
226	002912	中新赛克	100	9,387.00	0.01
227	002745	木林森	800	9,376.00	0.01
228	002097	山河智能	1,500	9,360.00	0.01
229	002104	恒宝股份	1,300	9,347.00	0.01
230	300266	兴源环境	2,050	9,307.00	0.01
231	300476	胜宏科技	820	9,266.00	0.01
232	300101	振芯科技	900	9,225.00	0.01
233	002156	通富微电	1,080	9,158.40	0.01
234	002544	杰赛科技	700	9,100.00	0.01
235	002672	东江环保	800	9,072.00	0.01
236	002697	红旗连锁	1,400	9,058.00	0.01
237	300297	蓝盾股份	1,500	9,045.00	0.01
238	300131	英唐智控	1,700	9,010.00	0.01
239	002022	科华生物	900	9,009.00	0.01
240	002047	宝鹰股份	1,600	8,976.00	0.01
241	002292	奥飞娱乐	1,400	8,974.00	0.01

242	300365	恒华科技	550	8,915.50	0.01
243	002424	贵州百灵	900	8,892.00	0.01
244	300137	先河环保	1,060	8,829.80	0.01
245	002041	登海种业	800	8,752.00	0.01
246	300177	中海达	1,000	8,720.00	0.01
247	300348	长亮科技	600	8,700.00	0.01
248	002161	远望谷	1,200	8,604.00	0.01
249	002474	榕基软件	1,000	8,590.00	0.01
250	300327	中颖电子	410	8,569.00	0.01
251	300633	开立医疗	300	8,568.00	0.01
252	002611	东方精工	2,200	8,470.00	0.01
253	002117	东港股份	800	8,360.00	0.01
254	300458	全志科技	400	8,360.00	0.01
255	002517	恺英网络	2,600	8,294.00	0.01
256	002375	亚厦股份	1,400	8,274.00	0.01
257	002309	中利集团	1,200	8,256.00	0.01
258	002303	美盈森	1,700	8,211.00	0.01
259	002326	永太科技	1,000	8,200.00	0.01
260	002108	沧州明珠	2,100	8,190.00	0.01
261	002341	新纶科技	1,400	8,176.00	0.01
262	002276	万马股份	1,500	8,175.00	0.01
263	300495	美尚生态	600	8,142.00	0.01
264	002698	博实股份	900	8,136.00	0.01
265	002192	融捷股份	400	8,120.00	0.01
266	002635	安洁科技	600	8,094.00	0.01
267	002564	天沃科技	1,400	8,092.00	0.01
268	002313	日海智能	400	8,080.00	0.01
269	300020	银江股份	1,000	8,060.00	0.01
270	002498	汉缆股份	2,700	7,992.00	0.01
271	300459	金科文化	1,400	7,966.00	0.01
272	300091	金通灵	1,600	7,952.00	0.01
273	300044	赛为智能	1,100	7,942.00	0.01
274	300474	景嘉微	200	7,892.00	0.01
275	300183	东软载波	500	7,840.00	0.01
276	002258	利尔化学	600	7,830.00	0.01
277	002222	福晶科技	700	7,819.00	0.01
278	300222	科大智能	600	7,812.00	0.01
279	002815	崇达技术	500	7,795.00	0.01
280	300257	开山股份	700	7,756.00	0.01
281	002737	葵花药业	500	7,695.00	0.01
282	002681	奋达科技	1,800	7,632.00	0.01
283	002585	双星新材	1,500	7,590.00	0.01

284	300666	江丰电子	200	7,584.00	0.01
285	002768	国恩股份	300	7,575.00	0.01
286	300149	量子生物	500	7,575.00	0.01
287	300616	尚品宅配	100	7,562.00	0.01
288	002522	浙江众成	1,000	7,510.00	0.01
289	002437	誉衡药业	1,900	7,505.00	0.01
290	002277	友阿股份	2,200	7,436.00	0.01
291	300572	安车检测	160	7,424.00	0.01
292	002307	北新路桥	1,100	7,392.00	0.01
293	002267	陕天然气	900	7,371.00	0.01
294	002489	浙江永强	2,200	7,348.00	0.01
295	002369	卓翼科技	900	7,326.00	0.01
296	300300	汉鼎宇佑	700	7,266.00	0.01
297	002095	生意宝	300	7,158.00	0.01
298	002936	郑州银行	1,400	7,112.00	0.01
299	300298	三诺生物	600	7,068.00	0.01
300	002509	天广中茂	3,400	7,004.00	0.01
301	002308	威创股份	1,400	6,972.00	0.01
302	002617	露笑科技	1,600	6,944.00	0.01
303	300568	星源材质	300	6,915.00	0.01
304	002382	蓝帆医疗	500	6,910.00	0.01
305	002705	新宝股份	600	6,900.00	0.01
306	002121	科陆电子	1,400	6,860.00	0.01
307	002619	艾格拉斯	2,000	6,840.00	0.01
308	002867	周大生	200	6,838.00	0.01
309	002434	万里扬	1,000	6,790.00	0.01
310	002542	中化岩土	1,500	6,765.00	0.01
311	002327	富安娜	900	6,723.00	0.01
312	002920	德赛西威	300	6,720.00	0.01
313	300075	数字政通	600	6,720.00	0.01
314	002240	威华股份	800	6,712.00	0.01
315	300224	正海磁材	750	6,652.50	0.01
316	002043	兔宝宝	1,100	6,644.00	0.01
317	300527	中国应急	600	6,630.00	0.01
318	002503	搜于特	2,400	6,600.00	0.01
319	300147	香雪制药	1,000	6,570.00	0.01
320	300039	上海凯宝	1,460	6,497.00	0.01
321	300236	上海新阳	200	6,488.00	0.01
322	002055	得润电子	600	6,468.00	0.01
323	002226	江南化工	1,200	6,456.00	0.01
324	002293	罗莱生活	650	6,441.50	0.01
325	002668	奥马电器	1,242	6,433.56	0.01

326	002251	步步高	800	6,376.00	0.01
327	002256	兆新股份	2,200	6,358.00	0.01
328	002370	亚太药业	400	6,320.00	0.00
329	300487	蓝晓科技	200	6,304.00	0.00
330	300725	药石科技	100	6,233.00	0.00
331	002204	大连重工	1,700	6,222.00	0.00
332	300252	金信诺	590	6,159.60	0.00
333	002747	埃斯顿	700	6,153.00	0.00
334	002707	众信旅游	1,000	6,070.00	0.00
335	002929	润建股份	200	6,052.00	0.00
336	300065	海兰信	500	6,010.00	0.00
337	300748	金力永磁	100	6,008.00	0.00
338	300373	扬杰科技	400	5,996.00	0.00
339	002061	浙江交科	1,000	5,980.00	0.00
340	300110	华仁药业	1,300	5,954.00	0.00
341	002626	金达威	500	5,860.00	0.00
342	002482	广田集团	1,200	5,832.00	0.00
343	300409	道氏技术	460	5,809.80	0.00
344	002621	美吉姆	440	5,755.20	0.00
345	002792	通宇通讯	250	5,742.50	0.00
346	002695	煌上煌	400	5,740.00	0.00
347	002653	海思科	400	5,680.00	0.00
348	002625	光启技术	610	5,666.90	0.00
349	300679	电连技术	200	5,572.00	0.00
350	300323	华灿光电	900	5,562.00	0.00
351	300456	耐威科技	200	5,460.00	0.00
352	002930	宏川智慧	340	5,457.00	0.00
353	300107	建新股份	600	5,442.00	0.00
354	002726	龙大肉食	500	5,440.00	0.00
355	300504	天邑股份	200	5,390.00	0.00
356	300523	辰安科技	100	5,386.00	0.00
357	300288	朗玛信息	400	5,324.00	0.00
358	300724	捷佳伟创	200	5,324.00	0.00
359	002677	浙江美大	400	5,264.00	0.00
360	002859	洁美科技	200	5,260.00	0.00
361	300685	艾德生物	100	5,237.00	0.00
362	002664	长鹰信质	400	5,236.00	0.00
363	002279	久其软件	750	5,197.50	0.00
364	300602	飞荣达	200	5,176.00	0.00
365	300735	光弘科技	300	5,124.00	0.00
366	300477	合纵科技	600	5,088.00	0.00
367	002416	爱施德	800	5,000.00	0.00

368	002636	金安国纪	500	4,995.00	0.00
369	300429	强力新材	500	4,980.00	0.00
370	002721	金一文化	800	4,976.00	0.00
371	300398	飞凯材料	400	4,964.00	0.00
372	300178	腾邦国际	800	4,920.00	0.00
373	002320	海峡股份	550	4,917.00	0.00
374	002530	金财互联	500	4,880.00	0.00
375	002314	南山控股	1,600	4,800.00	0.00
376	300726	宏达电子	200	4,720.00	0.00
377	300664	鹏鹞环保	400	4,716.00	0.00
378	002755	奥赛康	400	4,644.00	0.00
379	002182	云海金属	600	4,566.00	0.00
380	002928	华夏航空	400	4,472.00	0.00
381	002461	珠江啤酒	700	4,445.00	0.00
382	002818	富森美	340	4,362.20	0.00
383	300634	彩讯股份	200	4,334.00	0.00
384	300571	平治信息	100	4,155.00	0.00
385	002016	世荣兆业	500	4,100.00	0.00
386	002512	达华智能	900	4,068.00	0.00
387	002543	万和电气	300	4,026.00	0.00
388	002068	黑猫股份	800	3,992.00	0.00
389	300682	朗新科技	200	3,600.00	0.00
390	300064	豫金刚石	800	3,496.00	0.00
391	300276	三丰智能	400	3,376.00	0.00
392	002901	大博医疗	100	3,288.00	0.00
393	002545	东方铁塔	500	3,185.00	0.00
394	300741	华宝股份	100	3,170.00	0.00
395	002409	雅克科技	200	2,994.00	0.00
396	002907	华森制药	100	1,780.00	0.00
397	002911	佛燃股份	100	1,503.00	0.00
398	002906	华阳集团	100	1,129.00	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	002311	海大集团	444,859.00	0.40
2	002157	正邦科技	443,030.00	0.40
3	300146	汤臣倍健	349,601.00	0.31
4	002384	东山精密	340,546.00	0.30
5	002268	卫士通	336,238.00	0.30
6	002385	大北农	321,432.00	0.29

7	002127	南极电商	316,959.00	0.28
8	300450	先导智能	314,938.00	0.28
9	002463	沪电股份	291,793.00	0.26
10	002217	合力泰	286,457.00	0.26
11	002507	涪陵榨菜	272,970.00	0.24
12	002075	沙钢股份	266,554.00	0.24
13	002506	协鑫集成	262,136.00	0.23
14	300271	华宇软件	255,692.00	0.23
15	002602	世纪华通	254,634.40	0.23
16	002180	纳思达	251,983.00	0.23
17	002138	顺络电子	250,133.00	0.22
18	002916	深南电路	246,228.00	0.22
19	300012	华测检测	245,640.00	0.22
20	300166	东方国信	244,609.00	0.22

#### 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	002311	海大集团	525,262.00	0.47
2	002157	正邦科技	491,051.00	0.44
3	300146	汤臣倍健	402,949.00	0.36
4	002268	卫士通	379,558.00	0.34
5	002384	东山精密	366,555.00	0.33
6	300450	先导智能	338,470.87	0.30
7	002127	南极电商	337,800.00	0.30
8	002385	大北农	336,303.00	0.30
9	002463	沪电股份	319,827.00	0.29
10	002602	世纪华通	299,872.72	0.27
11	002217	合力泰	299,856.00	0.27
12	002507	涪陵榨菜	299,659.00	0.27
13	300170	汉得信息	283,874.00	0.25
14	002180	纳思达	283,474.00	0.25
15	002916	深南电路	281,183.96	0.25
16	002075	沙钢股份	280,577.18	0.25
17	300271	华宇软件	279,926.00	0.25
18	002506	协鑫集成	278,070.00	0.25
19	002221	东华能源	272,932.00	0.24
20	002373	千方科技	270,296.00	0.24

#### 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	47,444,875.08
卖出股票收入（成交）总额	51,793,035.45

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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	800.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	800.00	0.00

### 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128068	和而转债	8	800.00	0.00

注:报告期末,本基金仅持有上述 1 支债券。

### 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	115,483,177.93	91.18

### 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 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

(1) 2018 年 7 月 20 日，江西正邦科技股份有限公司发布关于公司下属分子公司收到《行政处罚决定书》及《责令改正违法行为决定书》的公告，公告披露江西正邦科技股份有限公司下属分公司肇东正邦养殖有限公司红光分公司因环保不达标收到肇东市环境保护局出具的《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕180506 号）、《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕0608 号）及《责令改正违法行为决定书》（肇环责改字〔2018〕0608 号）以及江西正邦科技股份有限公司子公司的其他处罚决定，受处罚金额累计为 205 万元。

2018 年 8 月 28 日，苏州东山精密制造股份有限公司发布《关于高新区分公司收到行政处罚决定书的公告》，公司下属的高新区分公司收到了苏州市虎丘区环境保护局出具的苏虎环行罚字（2018）第 061 号《行政处罚决定书》，根据相关规定，虎丘区环保局对高新区分公司作出如下行政处罚：（1）将案件移送公安机关；（2）责令停止违法行为；（3）合计罚款人民币 155.92 万元。

本基金投资于“正邦科技（002157）”、“东山精密（002384）”的决策程序说明：本基金投资目标为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，正邦科技、东山精密为标的指数的成份股，本基金投资于“正邦科技”、“东山精密”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他八名证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、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	26,080.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,267.78
5	应收申购款	39,647.50

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,995.36

#### 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

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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

份额级别	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(%)
嘉实中创 400ETF 联接 A	6,193	15,159.20	-	-	93,880,903.64	100.00
嘉实中创 400ETF 联接 C	750	11,060.18	-	-	8,295,132.33	100.00
合计	6,886	14,838.23	-	-	102,176,035.97	100.00

注：(1) 嘉实中创 400ETF 联接 A: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实中创 400ETF 联接 A 份额占嘉实中创 400ETF 联接 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实中创 400ETF 联接 A 份额占嘉实中创 400ETF 联接 A 总份额比例；

(2) 嘉实中创 400ETF 联接 C: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实中创 400ETF 联接 C 份额占嘉实中创 400ETF 联接 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实中创 400ETF 联接 C 份额占嘉实中创 400ETF 联接 C 总份额比例。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	嘉实中创 400ETF 联接 A	522,479.07	0.56
	嘉实中创 400ETF 联接 C	12,692.31	0.15

有本基金			
	合计	535,171.38	0.52

### 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	份额级别	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	嘉实中创 400ETF 联接 A	10~50
	嘉实中创 400ETF 联接 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实中创 400ETF 联接 A	0
	嘉实中创 400ETF 联接 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实中创 400ETF 联接 A	嘉实中创 400ETF 联接 C
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	98,564,819.45	5,481,005.42
本报告期基金总申购份额	56,320,983.73	28,918,321.69
减：本报告期基金总赎回份额	61,004,899.54	26,104,194.78
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	93,880,903.64	8,295,132.33

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

2019 年 2 月 2 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》自 2019

年 2 月 2 日起邵健先生不再担任公司副总经理，专注于专户产品的投资管理工作。

2019 年 3 月 30 日，本基金管理人发布《关于嘉实中创 400ETF 联接基金经理变更的公告》，增聘李直先生担任本基金基金经理职务，与基金经理刘珈吟女士共同管理本基金，陈正宪先生不再担任本基金基金经理。

2019 年 6 月 6 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，李松林先生因工作变动不再担任公司副总经理职务。

2019 年 6 月 12 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》，公司法定代表人变更为经雷先生。

#### (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	99,236,100.53	100.00%	92,421.90	100.00%	-

长城证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证	1	-	-	-	-	-

券股份有限 公司						
国都证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西藏东方财 富证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

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

## 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。

### 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
光大证券股份有限公司	1,132.50	20.01%	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	4,527.72	79.99%	-	-	-	-	1,098,917.80	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	关于增加大连网金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换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	2019年1月4日
2	关于增加奕丰基金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2019年1月28日
3	关于增加中信证券等为嘉实旗下基金代销机构的公告	中国证券报、管理人网站	2019年2月19日
4	关于增加广发证券等为嘉实旗下基金代销机构并开通定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2019年2月25日
5	关于增加唐鼎耀华为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2019年2月28日
6	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金	中国证券报、管理人网	2019年3月8日

	参与嘉实财富定投业务的公告	站	
7	关于增加青岛农商行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投及转换业务的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 3 月 26 日
8	关于嘉实中创 400ETF 联接基金经理变更的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 3 月 30 日
9	关于增加包商银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投及转换业务的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 4 月 11 日
10	关于增加植信基金为嘉实旗下基金代销机构并开展转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 6 月 19 日
11	关于增加通华财富为嘉实旗下基金代销机构并开展转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 6 月 21 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

2019 年 08 月 29 日