

中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 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。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由代董事长签发。

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 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末上市基金前十名持有人	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 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
基金简称	嘉实中创 400ETF
场内简称	中创 400ETF
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	34,561,264.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 11 日

2.2 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	<p>本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。</p> <p>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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。</p>
业绩比较基准	中创 400 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 姓名	胡勇钦	郭明

负责人	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）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100020	100140
法定代表人		经雷	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-4,994,326.03
本期利润	-8,991,914.93
加权平均基金份额本期利润	-0.2418
本期加权平均净值利润率	-15.53%
本期基金份额净值增长率	-14.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	15,697,688.64
期末可供分配基金份额利润	0.4542
期末基金资产净值	50,258,952.64
期末基金份额净值	1.4542
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	45.42%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低

于所列数字。

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

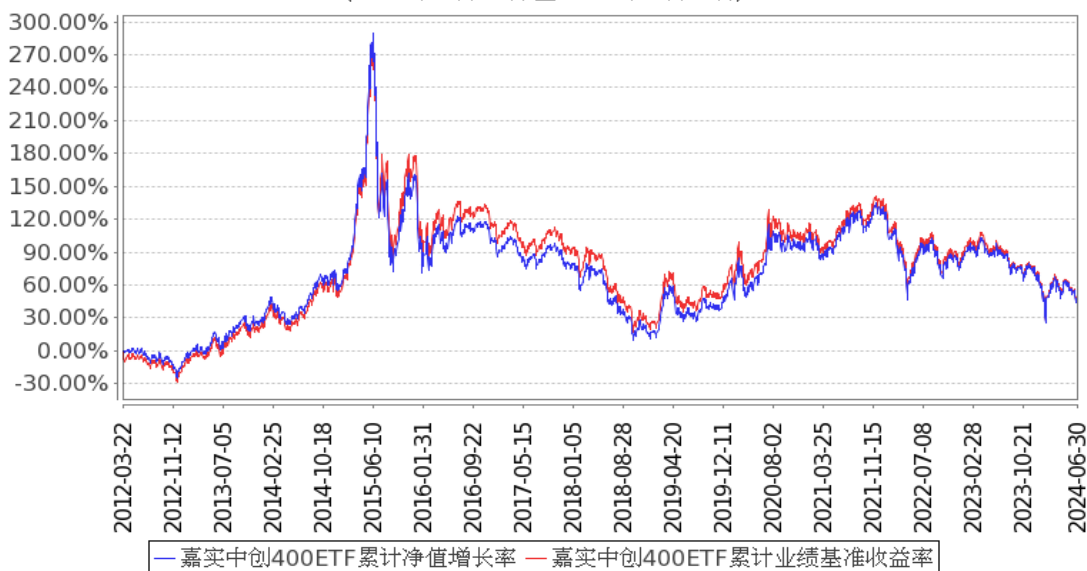
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.13%	1.34%	-7.30%	1.38%	0.17%	-0.04%
过去三个月	-8.67%	1.47%	-9.27%	1.50%	0.60%	-0.03%
过去六个月	-14.43%	1.97%	-14.84%	2.01%	0.41%	-0.04%
过去一年	-24.02%	1.56%	-24.83%	1.60%	0.81%	-0.04%
过去三年	-31.66%	1.42%	-33.19%	1.44%	1.53%	-0.02%
自基金合同生效起至今	45.42%	1.66%	46.29%	1.69%	-0.87%	-0.03%

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

嘉实中创400ETF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03月22日至2024年06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个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国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，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2024年6月30日，基金管理人共管理351只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

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		
张超梁	本基金、嘉实中创400ETF联接、嘉实中证信息安全主题ETF、嘉实中证高端装备细分50ETF基金经理	2024年2月1日	-	10年	曾任国金基金管理有限公司量化分析师助理、量化分析师、投资经理、基金经理助理，华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理，方正富邦基金管理有限公司指数投资部基金经理。2022年3月加入嘉实基金管理有限公司任SmartBeta和指数投资部投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
田光远	本基金、嘉实中证软件服务ETF、嘉实中证稀土产业ETF、嘉实中证电池主题ETF、嘉实中证稀土产业ETF联接、嘉实中证新能源ETF、	2021年9月4日	2024年2月1日	9年	曾任华创证券有限责任公司资产管理部量化研究员，2017年4月加入嘉实基金管理有限公司指数投资部，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。中国国籍。

<p>嘉实中证 稀有金属 主题 ETF、 嘉实中证 软件服务 ETF 联接、 嘉实中证 海外中国 互 联 网 30ETF (QDII)、 嘉实中证 稀有金属 主题 ETF 发 起 联 接、嘉实 中证芯片 产业指数 发起式、 嘉实中证 电池主题 ETF 发起 联接、嘉 实上证科 创板芯片 ETF、嘉实 上证科创 板 芯 片 ETF 发起 联接、嘉 实北证 50 成 份 指 数、嘉实 中证全指 集成电路 ETF、嘉实 中证机器 人 ETF 基 金经理</p>				
---	--	--	--	--

注：(1) 首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

(2) 证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
张超梁	公募基金	4	937,516,782.09	2024年1月25日
	私募资产管理计划	4	2,876,788,906.71	2022年7月21日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	3,814,305,688.80	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 9 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

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

本基金跟踪中小创业企业 400 指数，由中创 500 指数剔除同期中创 100 指数成份股后余下的 400 只股票组成，反映中小板和创业板中正处于高成长阶段的企业的整体状况。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

回顾上半年，经济基本面呈现弱复苏态势。1-2 月信贷弱于预期，但制造业开始回暖；3-4

月制造业景气持续上升，出口改善拉动需求，经济超预期恢复；5、6月制造业PMI稍有回落，至荣枯线以下，表明前期稳增长政策落地效果仍有待显现。市场走势方面，呈现为总体波动背景下的结构性行情：年初股市受到了较大的流动性冲击，但在大规模财政资金落地、出口持续改善、暂停新增转融通规模的影响下于春节后迅速恢复，超跌板块大都迎来反弹行情；近期制造业整体热度减退，但在消费电子需求提振、出口韧性及稳增长逻辑支持下，相关板块均有较好表现。回顾上半年海外经济，2月美国PCE价格指数同比小幅反弹，但核心PCE同比延续降温趋势，符合市场预期。在4月数据不及预期后，5月、6月制造业PMI均低于预期，表明美国制造业活动持续疲软。与此同时，美国通胀数据呈现降温趋势，市场降息预期抬升，市场整体上行。

本报告期内，本基金日均跟踪误差为0.05%，年化跟踪误差为0.77%。符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.2%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.4542元；本报告期基金份额净值增长率为-14.43%，业绩比较基准收益率为-14.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中创400指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中创400指数的投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期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本基金 2024 年中期报告中财务指标、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：中创 400 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,065,821.64	1,158,138.53
结算备付金		5,495.12	785.49
存出保证金		212.64	427.32
交易性金融资产	6.4.7.2	49,351,720.52	59,494,142.34
其中：股票投资		49,351,720.52	59,494,142.34
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	7,420.61
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		50,423,249.92	60,660,914.29
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		21,518.62	25,263.30
应付托管费		4,303.69	5,052.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	138,474.97	197,428.55
负债合计		164,297.28	227,744.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	34,561,264.00	35,561,264.00
未分配利润	6.4.7.12	15,697,688.64	24,871,905.80
净资产合计		50,258,952.64	60,433,169.80
负债和净资产总计		50,423,249.92	60,660,914.29

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4542 元，基金份额总额 34,561,264.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中创 400 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		-8,689,124.48	5,490,583.33
1. 利息收入		2,175.26	1,993.77
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,175.26	1,993.77
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,707,600.84	670,162.84
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,273,949.80	165,115.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	4,912.15
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	566,348.96	500,135.50
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-3,997,588.90	4,818,792.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	13,890.00	-366.04
减：二、营业总支出		302,790.45	330,274.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	144,135.11	161,012.79
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	28,827.00	32,202.62
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	129,828.34	137,058.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,991,914.93	5,160,309.26

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,991,914.93	5,160,309.26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,991,914.93	5,160,309.26

6.3 净资产变动表

会计主体：中创 400 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	35,561,264.00	-	24,871,905.80	60,433,169.80
二、本期期初净资产	35,561,264.00	-	24,871,905.80	60,433,169.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,000,000.00	-	-9,174,217.16	-10,174,217.16
（一）、综合收益总额	-	-	-8,991,914.93	-8,991,914.93
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,000,000.00	-	-182,302.23	-1,182,302.23
其中：1. 基金申购款	17,000,000.00	-	8,278,443.82	25,278,443.82
2. 基金赎回款	-18,000,000.00	-	-8,460,746.05	-26,460,746.05
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	34,561,264.00	-	15,697,688.64	50,258,952.64
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	33,561,264.00	-	25,727,443.36	59,288,707.36
二、本期期初净资产	33,561,264.00	-	25,727,443.36	59,288,707.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	4,942,347.82	4,942,347.82
(一)、综合收益总额	-	-	5,160,309.26	5,160,309.26
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-217,961.44	-217,961.44
其中：1. 基金申购款	5,000,000.00	-	4,515,312.69	9,515,312.69
2. 基金赎回款	-5,000,000.00	-	-4,733,274.13	-9,733,274.13
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	33,561,264.00	-	30,669,791.18	64,231,055.18

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

梁凯

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中创 400 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]13 号《关于核准中创 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《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型交易型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《中创 400 交易型开放式指数证券投资基

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 286,561,264.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（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〈年度报告和中期报告〉》、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》、《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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净资产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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
----	-------------------

活期存款	1,065,821.64
等于：本金	1,065,729.70
加：应计利息	91.94
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,065,821.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	60,572,662.16	-	49,351,720.52	-11,220,941.64
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	60,572,662.16	-	49,351,720.52	-11,220,941.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	8,802.63

其中：交易所市场	8,802.63
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	59,672.34
应付指数使用费	70,000.00
合计	138,474.97

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,561,264.00	35,561,264.00
本期申购	17,000,000.00	17,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-18,000,000.00	-18,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	34,561,264.00	34,561,264.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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	35,163,371.31	-10,291,465.51	24,871,905.80
本期期初	35,163,371.31	-10,291,465.51	24,871,905.80
本期利润	-4,994,326.03	-3,997,588.90	-8,991,914.93
本期基金份额交易产生的变动数	-440,095.47	257,793.24	-182,302.23
其中：基金申购款	15,804,528.49	-7,526,084.67	8,278,443.82
基金赎回款	-16,244,623.96	7,783,877.91	-8,460,746.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,728,949.81	-14,031,261.17	15,697,688.64

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
	活期存款利息收入

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	75.11
其他	1.80
合计	2,175.26

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	423,711.74
股票投资收益——赎回差价收入	-5,697,661.54
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-5,273,949.80

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	6,657,512.53
减：卖出股票成本总额	6,219,984.64
减：交易费用	13,816.15
买卖股票差价收入	423,711.74

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	26,460,746.05
减：现金支付赎回款总额	29,813.05
减：赎回股票成本总额	32,128,594.54
减：交易费用	-
赎回差价收入	-5,697,661.54

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	566,348.96
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	566,348.96

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,997,588.90
股票投资	-3,997,588.90
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-3,997,588.90

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	13,890.00
合计	13,890.00

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日

审计费用	19,890.78
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行划款手续费	156.00
指数使用费	70,000.00
合计	129,828.34

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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（“嘉实基金”）	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实中创 400ETF 联接”）	本基金的联接基金

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

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	144,135.11	161,012.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	144,135.11	161,012.79

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	28,827.00	32,202.62

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
嘉实中创 400ETF联接	31,394,808.00	90.84	31,414,808.00	88.34

6.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年6月30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,065,821.64	2,098.35	1,235,597.42	1,909.35

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期（2024年1月1日至2024年6月30日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024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

无。

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 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总 额	备注
300630	普利制药	2024 年5 月6 日	重大事 项停牌	12.35	2024 年7月 8日	9.88	4,931	134,558.96	60,897.85	-

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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拥有相关资质的银行，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与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额（计息但该利息金额不重大）以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约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相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,065,821.64	-	-	-	1,065,821.64
结算备付金	5,495.12	-	-	-	5,495.12
存出保证金	212.64	-	-	-	212.64
交易性金融资产	-	-	-	49,351,720.52	49,351,720.52
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,071,529.40	-	-	49,351,720.52	50,423,249.92
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	21,518.62	21,518.62
应付托管费	-	-	-	4,303.69	4,303.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	138,474.97	138,474.97
负债总计	-	-	-	164,297.28	164,297.28
利率敏感度缺口	1,071,529.40	-	-	49,187,423.24	50,258,952.64
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
货币资金	1,158,138.53	-	-	-	1,158,138.53
结算备付金	785.49	-	-	-	785.49
存出保证金	427.32	-	-	-	427.32
交易性金融资产	-	-	-	59,494,142.34	59,494,142.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	7,420.61	7,420.61
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,159,351.34	-	-	59,501,562.95	60,660,914.29
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	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	25,263.30	25,263.30
应付托管费	-	-	5,052.64	5,052.64
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	197,428.55	197,428.55
负债总计	-	-	227,744.49	227,744.49
利率敏感度缺口	1,159,351.34	-	59,273,818.46	60,433,169.80

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

假设	除市场利率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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-	-
	市场利率下降25个基点	-	-

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	所有外币相对人民币升值 5%		-
所有外币相对人民币贬值 5%		-	-

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	49,351,720.52	98.19	59,494,142.34	98.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	49,351,720.52	98.19	59,494,142.34	98.45

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%		2,465,517.31
业绩比较基准下降 5%		-2,465,517.31	-2,949,420.78

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	49,290,822.67	59,421,247.58
第二层次	60,897.85	-
第三层次	-	72,894.76
合计	49,351,720.52	59,494,142.34

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	49,351,720.52	97.87
	其中：股票	49,351,720.52	97.87
2	基金投资	-	-
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	1,071,316.76	2.12
8	其他各项资产	212.64	0.00
9	合计	50,423,249.92	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合**

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	437,133.92	0.87
B	采矿业	1,207,843.76	2.40
C	制造业	34,515,466.67	68.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	244,794.04	0.49
E	建筑业	348,325.40	0.69

F	批发和零售业	911,061.95	1.81
G	交通运输、仓储和邮政业	304,216.32	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,926,559.38	11.79
J	金融业	2,256,923.97	4.49
K	房地产业	217,131.00	0.43
L	租赁和商务服务业	587,213.22	1.17
M	科学研究和技术服务业	697,868.10	1.39
N	水利、环境和公共设施管理业	243,453.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	118,881.00	0.24
Q	卫生和社会工作	374,434.00	0.75
R	文化、体育和娱乐业	899,516.94	1.79
S	综合	-	-
	合计	49,290,822.67	98.07

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	60,897.85	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	60,897.85	0.12

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002156	通富微电	17,644	395,049.16	0.79
2	002625	光启技术	22,610	392,283.50	0.78
3	002966	苏州银行	49,560	371,700.00	0.74
4	002223	鱼跃医疗	9,800	368,480.00	0.73
5	002456	欧菲光	46,200	360,822.00	0.72
6	002078	太阳纸业	25,604	357,175.80	0.71
7	300573	兴齐眼药	2,116	347,024.00	0.69
8	002353	杰瑞股份	9,800	343,784.00	0.68
9	002185	华天科技	41,900	341,485.00	0.68
10	002128	电投能源	16,100	339,710.00	0.68
11	002532	天山铝业	41,700	338,187.00	0.67
12	002273	水晶光电	19,580	332,468.40	0.66
13	002797	第一创业	62,000	315,580.00	0.63
14	002465	海格通信	30,400	314,944.00	0.63
15	002138	顺络电子	11,294	310,133.24	0.62
16	300476	胜宏科技	9,580	309,050.80	0.61
17	002281	光迅科技	7,912	295,671.44	0.59
18	002409	雅克科技	4,500	283,095.00	0.56
19	002444	巨星科技	11,400	281,580.00	0.56
20	002008	大族激光	13,500	280,800.00	0.56
21	002517	恺英网络	29,100	277,905.00	0.55
22	300017	网宿科技	33,300	263,070.00	0.52
23	300136	信维通信	13,200	258,456.00	0.51
24	300339	润和软件	12,500	258,375.00	0.51
25	300054	鼎龙股份	11,229	254,673.72	0.51
26	002595	豪迈科技	6,640	253,448.80	0.50
27	002436	兴森科技	24,328	251,064.96	0.50

28	300474	景嘉微	3,950	249,758.50	0.50
29	300866	安克创新	3,480	247,810.80	0.49
30	002673	西部证券	40,000	247,600.00	0.49
31	002085	万丰奥威	18,700	247,588.00	0.49
32	300002	神州泰岳	30,100	244,412.00	0.49
33	002739	万达电影	20,000	241,800.00	0.48
34	002155	湖南黄金	13,200	238,920.00	0.48
35	002318	久立特材	10,200	237,966.00	0.47
36	300001	特锐德	11,774	236,892.88	0.47
37	002472	双环传动	10,700	235,614.00	0.47
38	300012	华测检测	22,900	230,374.00	0.46
39	300285	国瓷材料	12,800	228,480.00	0.45
40	300073	当升科技	6,600	226,446.00	0.45
41	300037	新宙邦	7,880	225,052.80	0.45
42	002850	科达利	2,900	221,502.00	0.44
43	300724	捷佳伟创	4,100	221,441.00	0.44
44	002405	四维图新	35,600	221,432.00	0.44
45	002152	广电运通	21,000	219,660.00	0.44
46	300058	蓝色光标	40,300	219,232.00	0.44
47	002126	银轮股份	12,334	214,734.94	0.43
48	002195	岩山科技	85,500	214,605.00	0.43
49	002410	广联达	22,400	214,592.00	0.43
50	300114	中航电测	4,700	212,675.00	0.42
51	002984	森麒麟	8,820	212,473.80	0.42
52	300395	菲利华	6,900	212,175.00	0.42
53	300699	光威复材	8,540	212,048.20	0.42
54	300346	南大光电	7,410	211,851.90	0.42
55	002294	信立泰	7,900	210,377.00	0.42
56	002262	恩华药业	8,853	210,170.22	0.42
57	002407	多氟多	17,180	210,111.40	0.42
58	002025	航天电器	4,504	208,895.52	0.42
59	300364	中文在线	9,500	205,010.00	0.41
60	301358	湖南裕能	6,500	204,490.00	0.41
61	002176	江特电机	24,800	202,120.00	0.40
62	002385	大北农	51,600	198,660.00	0.40
63	300251	光线传媒	23,400	196,794.00	0.39
64	300529	健帆生物	7,200	195,912.00	0.39
65	002558	巨人网络	20,600	194,464.00	0.39
66	002439	启明星辰	11,200	193,312.00	0.38
67	002270	华明装备	8,600	191,264.00	0.38
68	300383	光环新网	22,300	188,435.00	0.37
69	300677	英科医疗	7,000	187,670.00	0.37
70	002261	拓维信息	16,900	187,083.00	0.37

71	300373	扬杰科技	4,800	186,720.00	0.37
72	002958	青农商行	69,600	186,528.00	0.37
73	300024	机器人	18,900	184,086.00	0.37
74	002139	拓邦股份	17,300	183,726.00	0.37
75	300567	精测电子	3,200	180,832.00	0.36
76	300315	掌趣科技	43,100	179,727.00	0.36
77	002044	美年健康	47,500	179,550.00	0.36
78	300604	长川科技	6,600	179,322.00	0.36
79	300118	东方日升	14,548	176,030.80	0.35
80	300458	全志科技	7,430	174,679.30	0.35
81	300775	三角防务	5,700	174,420.00	0.35
82	300679	电连技术	4,300	172,989.00	0.34
83	300294	博雅生物	5,150	169,950.00	0.34
84	300253	卫宁健康	28,800	169,920.00	0.34
85	002429	兆驰股份	35,200	169,312.00	0.34
86	002430	杭氧股份	7,600	169,100.00	0.34
87	300487	蓝晓科技	4,025	168,084.00	0.33
88	002508	老板电器	7,600	167,960.00	0.33
89	002120	韵达股份	21,400	165,636.00	0.33
90	300390	天华新能	9,600	164,928.00	0.33
91	002056	横店东磁	13,100	163,357.00	0.33
92	300568	星源材质	19,837	162,663.40	0.32
93	300633	开立医疗	4,100	162,278.00	0.32
94	002831	裕同科技	6,240	159,681.60	0.32
95	002372	伟星新材	10,248	158,024.16	0.31
96	300762	上海瀚讯	8,812	157,822.92	0.31
97	002624	完美世界	20,600	156,560.00	0.31
98	002926	华西证券	23,700	156,183.00	0.31
99	300088	长信科技	33,200	156,040.00	0.31
100	002837	英维克	7,290	155,933.10	0.31
101	002065	东华软件	34,400	155,488.00	0.31
102	300009	安科生物	18,188	155,325.52	0.31
103	002851	麦格米特	6,000	155,040.00	0.31
104	300115	长盈精密	12,866	154,263.34	0.31
105	002151	北斗星通	6,377	154,195.86	0.31
106	300763	锦浪科技	3,700	154,068.00	0.31
107	002936	郑州银行	88,846	153,703.58	0.31
108	002373	千方科技	16,900	153,283.00	0.30
109	002507	涪陵榨菜	12,410	152,022.50	0.30
110	300627	华测导航	5,060	151,041.00	0.30
111	002368	太极股份	6,651	149,980.05	0.30
112	002497	雅化集团	16,778	149,659.76	0.30
113	002332	仙琚制药	13,100	149,471.00	0.30

114	300803	指南针	4,100	149,281.00	0.30
115	002240	盛新锂能	11,100	148,962.00	0.30
116	002487	大金重工	6,500	148,720.00	0.30
117	300296	利亚德	33,000	148,500.00	0.30
118	300459	汤姆猫	43,723	148,220.97	0.29
119	002500	山西证券	31,480	147,956.00	0.29
120	002807	江阴银行	39,182	147,716.14	0.29
121	002019	亿帆医药	11,900	147,084.00	0.29
122	002568	百润股份	8,700	146,421.00	0.29
123	002203	海亮股份	18,300	146,034.00	0.29
124	002003	伟星股份	11,600	145,580.00	0.29
125	002683	广东宏大	7,200	144,936.00	0.29
126	002389	航天彩虹	10,382	144,205.98	0.29
127	002222	福晶科技	6,380	143,741.40	0.29
128	002145	中核钛白	43,595	142,991.60	0.28
129	300666	江丰电子	3,000	142,680.00	0.28
130	300857	协创数据	2,500	142,500.00	0.28
131	301308	江波龙	1,500	142,110.00	0.28
132	002557	洽洽食品	5,000	140,950.00	0.28
133	002402	和而泰	13,100	140,301.00	0.28
134	002572	索菲亚	9,100	139,503.00	0.28
135	300070	碧水源	33,000	138,270.00	0.28
136	300558	贝达药业	4,200	136,710.00	0.27
137	300676	华大基因	3,900	136,539.00	0.27
138	002506	协鑫集成	70,000	135,800.00	0.27
139	002299	圣农发展	9,900	135,036.00	0.27
140	002131	利欧股份	94,054	134,497.22	0.27
141	301301	川宁生物	10,500	134,190.00	0.27
142	002531	天顺风能	14,900	133,206.00	0.27
143	300182	捷成股份	35,714	132,498.94	0.26
144	002268	电科网安	9,291	132,210.93	0.26
145	300735	光弘科技	6,100	131,760.00	0.26
146	300045	华力创通	7,400	130,610.00	0.26
147	300212	易华录	7,717	129,877.11	0.26
148	002221	东华能源	15,800	129,718.00	0.26
149	002832	比音勒芬	5,362	129,599.54	0.26
150	300456	赛微电子	8,050	127,753.50	0.25
151	300748	金力永磁	9,840	127,526.40	0.25
152	300638	广和通	7,426	126,984.60	0.25
153	300298	三诺生物	5,000	126,700.00	0.25
154	002244	滨江集团	17,400	126,324.00	0.25
155	300624	万兴科技	2,377	126,147.39	0.25
156	002653	海思科	4,100	125,870.00	0.25

157	002317	众生药业	11,000	125,730.00	0.25
158	300595	欧普康视	8,000	125,440.00	0.25
159	300199	翰宇药业	11,500	124,775.00	0.25
160	002249	大洋电机	26,288	124,342.24	0.25
161	300475	香农芯创	4,200	124,194.00	0.25
162	002675	东诚药业	10,100	123,826.00	0.25
163	300133	华策影视	20,100	123,414.00	0.25
164	300777	中简科技	5,700	122,550.00	0.24
165	002745	木林森	15,200	122,512.00	0.24
166	002245	蔚蓝锂芯	15,800	122,450.00	0.24
167	300034	钢研高纳	7,700	122,353.00	0.24
168	002747	埃斯顿	8,600	122,292.00	0.24
169	300672	国科微	2,300	121,532.00	0.24
170	300229	拓尔思	9,000	120,870.00	0.24
171	002701	奥瑞金	29,000	120,640.00	0.24
172	002544	普天科技	6,384	119,316.96	0.24
173	002607	中公教育	77,700	118,881.00	0.24
174	002063	远光软件	22,650	118,686.00	0.24
175	002617	露笑科技	24,600	118,080.00	0.23
176	002100	天康生物	17,000	117,810.00	0.23
177	002182	宝武镁业	10,420	117,537.60	0.23
178	002773	康弘药业	5,400	116,910.00	0.23
179	002698	博实股份	9,500	116,565.00	0.23
180	002312	川发龙蟒	17,200	115,756.00	0.23
181	002408	齐翔腾达	20,499	114,794.40	0.23
182	002015	协鑫能科	14,300	113,828.00	0.23
183	300525	博思软件	8,920	113,284.00	0.23
184	300623	捷捷微电	6,450	111,585.00	0.22
185	300236	上海新阳	3,550	110,547.00	0.22
186	002484	江海股份	8,300	109,975.00	0.22
187	002036	联创电子	16,276	109,863.00	0.22
188	003031	中瓷电子	2,360	109,126.40	0.22
189	300438	鹏辉能源	5,900	108,206.00	0.22
190	002567	唐人神	19,900	106,664.00	0.21
191	002839	张家港行	26,480	106,449.60	0.21
192	002948	青岛银行	31,420	105,885.40	0.21
193	002597	金禾实业	5,300	105,417.00	0.21
194	002266	浙富控股	37,700	105,183.00	0.21
195	002091	江苏国泰	15,445	105,180.45	0.21
196	002237	恒邦股份	9,100	104,741.00	0.21
197	300761	立华股份	4,600	104,144.00	0.21
198	300910	瑞丰新材	2,380	104,053.60	0.21
199	300026	红日药业	34,000	103,700.00	0.21

200	002541	鸿路钢构	6,110	103,686.70	0.21
201	002335	科华数据	4,900	103,537.00	0.21
202	300482	万孚生物	4,236	103,358.40	0.21
203	300773	拉卡拉	8,300	103,169.00	0.21
204	300130	新国都	6,200	103,168.00	0.21
205	002075	沙钢股份	27,200	102,544.00	0.20
206	300457	赢合科技	5,750	102,522.50	0.20
207	300068	南都电源	12,375	102,465.00	0.20
208	300776	帝尔激光	2,208	101,479.68	0.20
209	301050	雷电微力	2,100	101,136.00	0.20
210	002737	葵花药业	4,300	100,534.00	0.20
211	300101	振芯科技	6,800	100,436.00	0.20
212	300036	超图软件	7,100	99,116.00	0.20
213	002192	融捷股份	3,300	99,066.00	0.20
214	300618	寒锐钴业	3,740	98,923.00	0.20
215	300769	德方纳米	3,500	98,700.00	0.20
216	002048	宁波华翔	7,600	98,344.00	0.20
217	300674	宇信科技	8,820	97,725.60	0.19
218	002396	星网锐捷	7,293	96,340.53	0.19
219	002906	华阳集团	3,600	96,336.00	0.19
220	002171	楚江新材	14,400	94,896.00	0.19
221	002706	良信股份	13,780	94,530.80	0.19
222	002416	爱施德	10,600	93,810.00	0.19
223	002539	云图控股	13,100	93,403.00	0.19
224	002011	盾安环境	9,500	93,385.00	0.19
225	300244	迪安诊断	7,700	92,400.00	0.18
226	300855	图南股份	3,490	92,275.60	0.18
227	300327	中颖电子	4,688	92,259.84	0.18
228	002004	华邦健康	24,200	91,960.00	0.18
229	002865	钧达股份	2,378	91,267.64	0.18
230	300357	我武生物	4,500	90,990.00	0.18
231	300747	锐科激光	5,112	90,738.00	0.18
232	002351	漫步者	6,900	90,735.00	0.18
233	002423	中粮资本	12,100	90,629.00	0.18
234	002643	万润股份	8,950	89,500.00	0.18
235	002212	天融信	18,300	89,121.00	0.18
236	002324	普利特	10,400	88,920.00	0.18
237	002867	周大生	6,775	88,481.50	0.18
238	002233	塔牌集团	12,100	88,451.00	0.18
239	300655	晶瑞电材	12,279	88,408.80	0.18
240	300188	国投智能	7,820	86,880.20	0.17
241	002239	奥特佳	37,600	86,480.00	0.17
242	300685	艾德生物	4,890	86,259.60	0.17

243	002292	奥飞娱乐	14,400	86,112.00	0.17
244	300035	中科电气	10,100	85,951.00	0.17
245	002468	申通快递	10,200	85,680.00	0.17
246	300151	昌红科技	5,400	85,428.00	0.17
247	300166	东方国信	13,956	85,410.72	0.17
248	301039	中集车辆	9,900	85,140.00	0.17
249	002326	永太科技	10,864	84,956.48	0.17
250	002458	益生股份	9,782	84,712.12	0.17
251	002099	海翔药业	16,472	84,171.92	0.17
252	300079	数码视讯	20,700	84,042.00	0.17
253	002690	美亚光电	5,060	83,490.00	0.17
254	300185	通裕重工	48,300	83,076.00	0.17
255	300113	顺网科技	8,100	82,944.00	0.17
256	002254	泰和新材	9,340	82,659.00	0.16
257	300168	万达信息	17,400	82,650.00	0.16
258	002183	怡亚通	28,800	81,792.00	0.16
259	002727	一心堂	5,400	81,486.00	0.16
260	002761	浙江建投	10,400	81,224.00	0.16
261	002030	达安基因	16,220	81,100.00	0.16
262	002061	浙江交科	22,140	80,811.00	0.16
263	300463	迈克生物	7,100	80,798.00	0.16
264	002038	双鹭药业	10,800	79,596.00	0.16
265	002635	安洁科技	5,150	79,516.00	0.16
266	300827	上能电气	3,545	79,266.20	0.16
267	002815	崇达技术	8,431	79,082.78	0.16
268	300888	稳健医疗	3,120	78,936.00	0.16
269	002608	江苏国信	10,100	78,275.00	0.16
270	300398	飞凯材料	6,360	78,228.00	0.16
271	300682	朗新集团	9,150	77,866.50	0.15
272	002670	国盛金控	9,175	77,712.25	0.15
273	002960	青鸟消防	6,090	76,977.60	0.15
274	002511	中顺洁柔	11,040	76,396.80	0.15
275	002840	华统股份	4,600	76,314.00	0.15
276	002010	传化智联	19,800	76,032.00	0.15
277	300432	富临精工	11,800	75,992.00	0.15
278	003035	南网能源	17,200	75,680.00	0.15
279	002127	南极电商	29,100	75,660.00	0.15
280	002153	石基信息	13,160	75,406.80	0.15
281	300492	华图山鼎	800	75,360.00	0.15
282	300171	东富龙	6,300	74,907.00	0.15
283	002583	海能达	18,390	74,847.30	0.15
284	002226	江南化工	16,700	74,816.00	0.15
285	300393	中来股份	12,900	74,433.00	0.15

286	300770	新媒股份	2,200	73,436.00	0.15
287	300379	东方通	8,940	72,235.20	0.14
288	300783	三只松鼠	3,300	72,171.00	0.14
289	002726	龙大美食	10,960	71,897.60	0.14
290	002605	姚记科技	3,500	71,470.00	0.14
291	300593	新雷能	7,188	71,448.72	0.14
292	003022	联泓新科	5,200	71,292.00	0.14
293	301035	润丰股份	1,600	71,264.00	0.14
294	300841	康华生物	1,400	70,896.00	0.14
295	002626	金达威	4,900	70,805.00	0.14
296	300602	飞荣达	4,661	70,427.71	0.14
297	300725	药石科技	2,630	70,405.10	0.14
298	301219	腾远钴业	1,840	70,398.40	0.14
299	300224	正海磁材	7,553	69,940.78	0.14
300	002563	森马服饰	12,000	69,720.00	0.14
301	002847	盐津铺子	1,610	68,859.70	0.14
302	002081	金螳螂	22,600	68,478.00	0.14
303	002895	川恒股份	3,700	67,747.00	0.13
304	002705	新宝股份	4,800	67,536.00	0.13
305	300772	运达股份	7,020	67,392.00	0.13
306	300376	易事特	16,800	67,368.00	0.13
307	002518	科士达	3,800	67,260.00	0.13
308	002993	奥海科技	1,800	66,960.00	0.13
309	300451	创业慧康	19,135	66,207.10	0.13
310	002859	洁美科技	3,280	65,862.40	0.13
311	300363	博腾股份	5,500	65,725.00	0.13
312	300087	荃银高科	10,610	65,569.80	0.13
313	300428	立中集团	3,500	65,065.00	0.13
314	300257	开山股份	6,400	64,640.00	0.13
315	002060	广东建工	18,900	64,638.00	0.13
316	300260	新莱应材	3,080	64,495.20	0.13
317	002258	利尔化学	8,040	64,480.80	0.13
318	300856	科思股份	2,000	64,020.00	0.13
319	300406	九强生物	4,100	63,058.00	0.13
320	002985	北摩高科	2,859	62,983.77	0.13
321	300613	富瀚微	1,905	62,693.55	0.12
322	002498	汉缆股份	18,800	61,852.00	0.12
323	301095	广立微	1,500	61,680.00	0.12
324	301071	力量钻石	2,220	61,516.20	0.12
325	002146	荣盛发展	40,800	60,792.00	0.12
326	002390	信邦制药	18,300	60,573.00	0.12
327	301155	海力风电	1,500	60,345.00	0.12
328	301267	华夏眼科	2,900	60,088.00	0.12

329	301047	义翘神州	1,000	59,950.00	0.12
330	002545	东方铁塔	8,700	59,247.00	0.12
331	002158	汉钟精机	3,500	58,520.00	0.12
332	300443	金雷股份	3,800	58,254.00	0.12
333	003021	兆威机电	1,260	58,149.00	0.12
334	002101	广东鸿图	5,500	57,915.00	0.12
335	002216	三全食品	5,260	57,754.80	0.11
336	002585	双星新材	11,600	57,536.00	0.11
337	002191	劲嘉股份	15,600	56,316.00	0.11
338	002925	盈趣科技	4,430	56,128.10	0.11
339	301238	瑞泰新材	3,700	55,389.00	0.11
340	002243	力合科创	10,000	55,300.00	0.11
341	301363	美好医疗	1,900	55,100.00	0.11
342	301029	怡合达	2,788	54,812.08	0.11
343	002051	中工国际	7,640	53,174.40	0.11
344	002204	大连重工	12,400	52,948.00	0.11
345	002320	海峡股份	10,252	52,900.32	0.11
346	002791	坚朗五金	2,000	51,740.00	0.10
347	300323	华灿光电	11,800	51,330.00	0.10
348	300820	英杰电气	1,300	51,142.00	0.10
349	300723	一品红	2,600	51,090.00	0.10
350	002110	三钢闽光	17,200	50,740.00	0.10
351	301153	中科江南	1,780	50,302.80	0.10
352	300726	宏达电子	2,200	50,160.00	0.10
353	002096	易普力	4,200	49,980.00	0.10
354	300861	美畅股份	2,580	49,923.00	0.10
355	002967	广电计量	4,200	49,560.00	0.10
356	002041	登海种业	5,900	47,672.00	0.09
357	300850	新强联	3,150	47,313.00	0.09
358	301015	百洋医药	2,000	47,060.00	0.09
359	002434	万里扬	9,400	46,060.00	0.09
360	002242	九阳股份	4,300	45,064.00	0.09
361	003012	东鹏控股	7,300	44,603.00	0.09
362	002461	珠江啤酒	6,000	44,520.00	0.09
363	002612	朗姿股份	3,200	44,224.00	0.09
364	300072	海新能科	24,500	44,100.00	0.09
365	301205	联特科技	700	43,925.00	0.09
366	301207	华兰疫苗	2,450	43,291.50	0.09
367	002302	西部建设	8,300	43,160.00	0.09
368	002913	奥士康	1,600	42,896.00	0.09
369	301239	普瑞眼科	1,200	42,396.00	0.08
370	300702	天宇股份	2,340	41,722.20	0.08
371	301078	孩子王	8,200	41,492.00	0.08

372	300821	东岳硅材	5,800	39,672.00	0.08
373	003040	楚天龙	3,200	39,360.00	0.08
374	300768	迪普科技	3,250	38,512.50	0.08
375	002959	小熊电器	800	38,488.00	0.08
376	301498	乖宝宠物	700	37,660.00	0.07
377	002088	鲁阳节能	3,100	37,479.00	0.07
378	301217	铜冠铜箔	3,900	37,440.00	0.07
379	300973	立高食品	1,300	36,517.00	0.07
380	301165	锐捷网络	1,200	35,808.00	0.07
381	301268	铭利达	2,300	35,765.00	0.07
382	301327	华宝新能	600	34,380.00	0.07
383	300869	康泰医学	2,600	33,982.00	0.07
384	002265	建设工业	3,900	33,657.00	0.07
385	002978	安宁股份	1,200	33,432.00	0.07
386	300080	易成新能	11,200	32,256.00	0.06
387	002534	西子洁能	3,000	30,030.00	0.06
388	002314	南山控股	14,500	30,015.00	0.06
389	300755	华致酒行	2,100	28,686.00	0.06
390	002901	大博医疗	1,100	28,413.00	0.06
391	300140	节能环境	4,700	28,059.00	0.06
392	301069	凯盛新材	2,100	27,531.00	0.05
393	002911	佛燃能源	2,886	26,378.04	0.05
394	003039	顺控发展	2,100	26,313.00	0.05
395	301487	盟固利	1,000	25,860.00	0.05
396	002505	鹏都农牧	57,250	25,190.00	0.05
397	002946	新乳业	2,600	22,776.00	0.05
398	301510	固高科技	700	19,425.00	0.04
399	301262	海看股份	800	18,040.00	0.04
400	301177	迪阿股份	700	13,020.00	0.03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300630	普利制药	4,931	60,897.85	0.12

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 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	300724	捷佳伟创	255,821.00	0.42
2	002410	广联达	243,722.00	0.40
3	300364	中文在线	196,940.00	0.33
4	300763	锦浪科技	187,943.00	0.31

5	301358	湖南裕能	182,370.00	0.30
6	002270	华明装备	179,711.00	0.30
7	002120	韵达股份	168,836.00	0.28
8	002568	百润股份	168,792.00	0.28
9	002240	盛新锂能	166,619.00	0.28
10	002222	福晶科技	149,442.00	0.25
11	002003	伟星股份	147,817.00	0.24
12	300857	协创数据	145,584.00	0.24
13	300045	华力创通	133,837.00	0.22
14	300735	光弘科技	126,110.00	0.21
15	300573	兴齐眼药	111,369.00	0.18
16	301301	川宁生物	91,753.00	0.15
17	002850	科达利	90,968.00	0.15
18	002840	华统股份	86,927.00	0.14
19	300492	华图山鼎	82,966.00	0.14
20	003022	联泓新科	80,584.00	0.13

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 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	300502	新易盛	1,021,895.50	1.69
2	002463	沪电股份	754,912.60	1.25
3	002028	思源电气	661,905.00	1.10
4	300394	天孚通信	457,752.60	0.76
5	301236	软通动力	404,060.00	0.67
6	300765	新诺威	191,823.00	0.32
7	300573	兴齐眼药	124,835.00	0.21
8	002092	ST 中泰	118,238.00	0.20
9	002424	ST 百灵	85,412.00	0.14
10	002214	大立科技	83,994.00	0.14
11	002123	梦网科技	82,962.53	0.14
12	300348	长亮科技	71,084.50	0.12
13	300671	富满微	70,522.00	0.12
14	002250	联化科技	62,156.00	0.10
15	002163	海南发展	61,795.00	0.10
16	300624	万兴科技	52,203.00	0.09
17	301080	百普赛斯	51,472.00	0.09
18	300369	绿盟科技	51,070.66	0.08
19	300737	科顺股份	47,006.80	0.08
20	301089	拓新药业	43,364.00	0.07

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	7,198,864.26
--------------	--------------

卖出股票收入（成交）总额	6,657,512.53
--------------	--------------

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	212.64
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	212.64

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	300630	普利制药	60,897.85	0.12	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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

8.1.1 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 (%)
329	105,049.43	32,464,505.00	93.93	2,096,759.00	6.07

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实中创 400 交易型开放式 指数证券投资基金联接基金	31,394,808.00	90.84

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
----	-------	----------	--------------

1	海通证券股份有限公司	561,065.00	1.62
2	中信证券股份有限公司	508,632.00	1.47
3	骆华星	215,355.00	0.62
4	徐隽婵	103,270.00	0.30
5	谭惠玲	100,009.00	0.29
6	刘亦男	63,600.00	0.18
7	全玉宝	60,500.00	0.18
8	刘子瑛	60,000.00	0.17
9	叶碧霞	49,200.00	0.14
10	周曦	48,150.00	0.14
11	嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	31,394,808.00	90.84

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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、基金投资和研发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	286,561,264.00
本报告期期初基金份额总额	35,561,264.00
本报告期基金总申购份额	17,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	34,561,264.00

§ 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内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 (%)	
中国国际金融股份有限公司	2	10,026,852.35	72.36	7,018.93	73.12	-
海通证券股份有限公司	3	1,087,186.19	7.85	761.07	7.93	-
开源证券股份有限公司	3	1,029,076.42	7.43	664.67	6.92	-
招商证券	2	850,433.26	6.14	595.36	6.20	-

股份有限 公司						
广发证券 股份有限 公司	5	813,492.00	5.87	525.47	5.47	-
国信证券 股份有限 公司	2	19,084.40	0.14	13.37	0.14	-
华泰证券 股份有限 公司	3	16,524.08	0.12	10.66	0.11	-
长江证券 股份有限 公司	2	9,853.46	0.07	6.91	0.07	-
国泰君安 证券股份 有限公司	3	2,584.39	0.02	1.82	0.02	-
浙商证券 股份有限 公司	2	1,290.24	0.01	0.83	0.01	-
财通证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东方财富 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
高盛高华 证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

国都证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任公司	4	-	-	-	-	-
国投证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华金证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华源证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限公司	4	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	1	-	-	-	-	-

有限公司						
中泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	5	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

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

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

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。

3. 报告期内，本基金退租以下交易单元：中国中金财富证券有限公司退租交易单元 1 个。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：天风证券股份有限公司新增交易单元 2 个，中信证券股份有限公司新增交易单元 1 个。

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	
	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(%)
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
开源证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
长江证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
财通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
德邦证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有	-	-	-	-	-	-

限公司						
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东吴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东兴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
高盛高 华证券 有限责 任公司	-	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国都证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国联证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
国投证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华宝证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

司						
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

限公司						
中信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-

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	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年1月8日
2	关于嘉实中创 400ETF 基金经理变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年2月1日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	1	2024-01-01至 2024-06-30	31,414,808.00	6,000,000.00	6,020,000.00	31,394,808.00	90.84

产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准中创 400 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

- (4) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议》;
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (6) 报告期内中创 400 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日