

中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 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：2016 年 3 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。董事 Bernd Amlung 未参会。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

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、基金净值表现及利润分配情况	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 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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
§5 托管人报告	14
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
§6 审计报告	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
8.3 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.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	60
8.7 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.....	60
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	60
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	60

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 投资组合报告附注	60
§9 基金份额持有人信息	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末上市基金前十名持有人	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.4 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的情况	62
§10 开放式基金份额变动	62
§11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	65
§12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 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 400
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	67,561,264.00 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	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。
业绩比较基准	中创 400 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	洪渊
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	400-600-8800	95588
传真	(010) 65182266	(010)66105798
注册地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 46 层 06-08 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	邓红国	姜建清

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》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	19,403,013.03	27,031,337.63	21,681,008.06
本期利润	24,510,785.16	24,515,437.59	59,556,562.08
加权平均基金份额本期利润	0.3583	0.2582	0.4391
本期加权平均净值利润率	14.99%	17.66%	40.96%
本期基金份额净值增长率	63.33%	22.44%	41.09%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	56,925,255.68	38,480,009.26	14,299,154.12
期末可供分配基金份额利润	0.8426	0.5026	0.1944
期末基金资产净值	172,214,937.48	119,483,911.89	93,758,665.17
期末基金份额净值	2.5490	1.5606	1.2746
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末

基金份额累计净值增长率	154.90%	56.06%	27.46%
-------------	---------	--------	--------

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

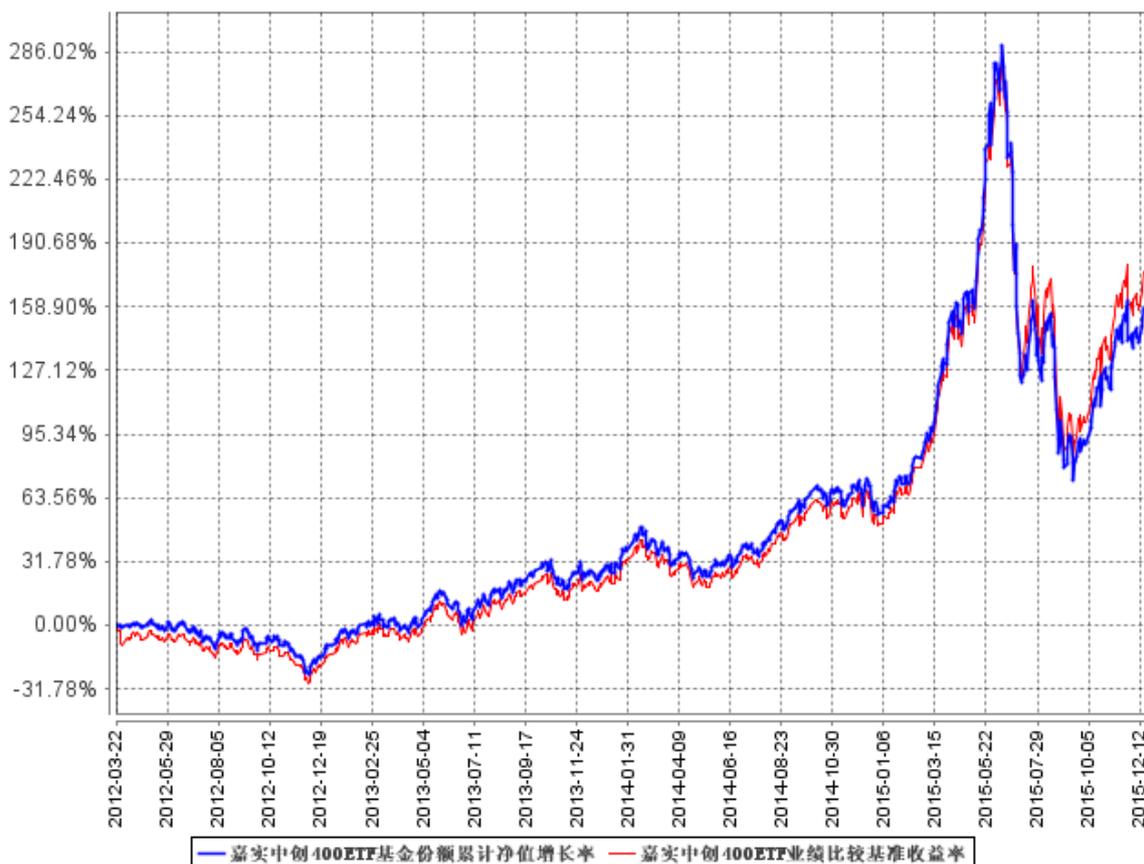
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	33.89%	2.21%	35.12%	2.26%	-1.23%	-0.05%
过去六个月	-12.02%	3.03%	-5.21%	3.16%	-6.81%	-0.13%
过去一年	63.33%	2.76%	81.10%	2.83%	-17.77%	-0.07%
过去三年	182.16%	2.01%	217.49%	2.05%	-35.33%	-0.04%
自基金合同生效起至今	154.90%	1.89%	172.39%	1.94%	-17.49%	-0.05%

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基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



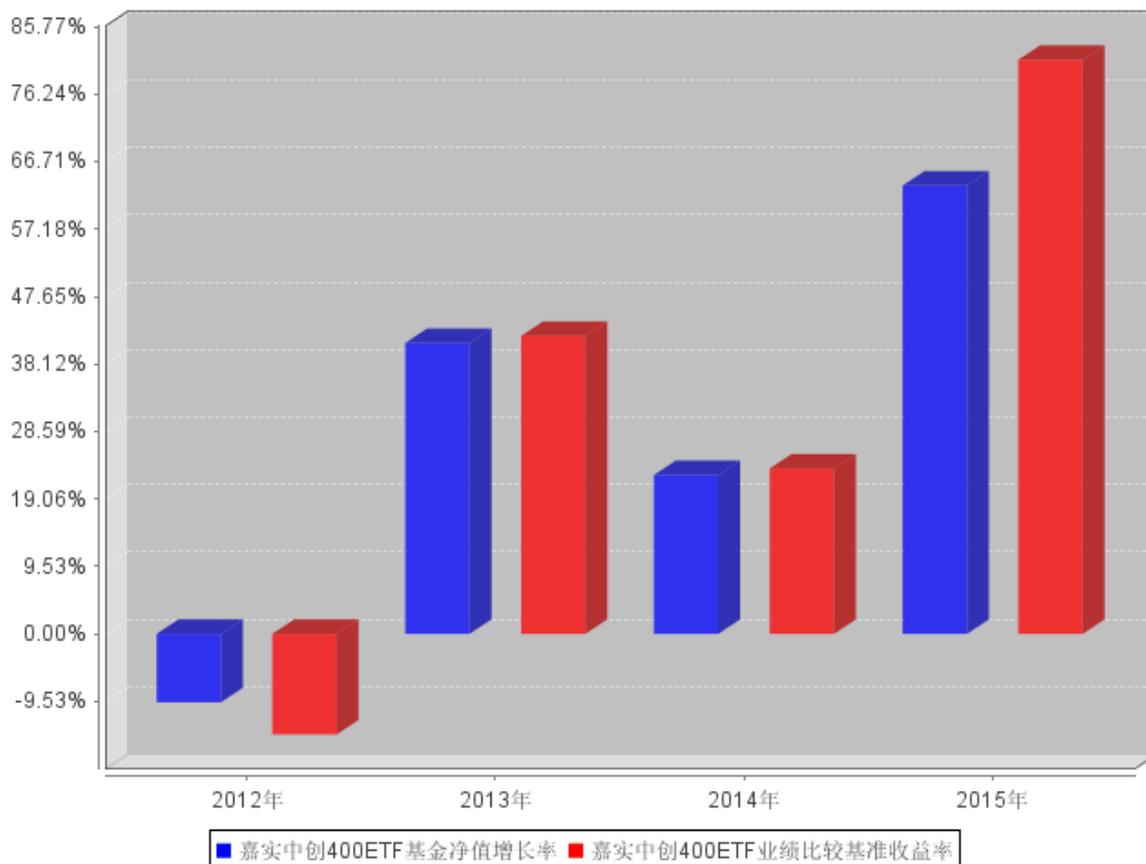
图：嘉实中创 400ETF 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 3 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十三部分二、投资范围和六、投资限制（一）投资组合限制”的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实中创400ETF自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为2012年3月22日，2012年度的相关数据根据当年实际存续期（2012年3月22日至2012年12月31日）计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于1999年3月25日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。

截止2015年12月31日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、79只开放式证券投资

资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300 ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何如	本基金基金经理、嘉实中创 400ETF 联接、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、嘉实沪	2014 年 5 月 9 日	-	9 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有

	深 300ETF、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实中证 500ETF 及其联接、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、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) 基金经理				限公司, 先后任职于产品管理部、指数投资部, 现任公司指数投资部基金经理。硕士研究生, 具有基金从业资格, 加拿大籍。
--	--	--	--	--	---

注: (1) 任职日期是指公司作出决定后公告之日; (2) 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定; (3) 2016 年 3 月 24 日, 本基金管理人发布《关于嘉实中创 400ETF 基金经理变更的公告》, 何如女士不再担任本基金基金经理, 聘请陈正宪先生、刘珈吟女士担任本基金基金经理职务。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》, 按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定, 从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面, 确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合, 杜绝不同投资组合之间进行利益输送, 保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议, 并在投资决策委员会的制度规范下独立决策, 实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离, 任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利, 共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则, 保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、

非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 5 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易，不存在利益输送等异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

中创 400 指数挑选在深圳证券交易所中小企业板及创业板上市的 400 只 A 股组成，其成份股所属企业具备成长性高、区域优势明显、且创新能力强的特性。报告期内，中创 400 指数上涨 81.10%。

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.23%，年度化拟合偏离度为 3.59%。报告期内，市场发生剧烈震荡，持续多日发生巨幅波动，且指数成份股停牌股票的权重在组合中占比较大，加上基金申赎、成份股调整、成分股分红等因素，导致了报告期内基金的跟踪误差与正常市场情况相比较

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.5490 元；本报告期基金份额净值增长率为 63.33%，业绩比较基准收益率为 81.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，中创 400 指数成分股主要为小市值股票，虽然其估值水平普遍较主板大市值股票高，但鉴于当前中国经济转型期的大背景和新兴产业未来发展，中创 400 指数长期的投资价值依然明显。

本基金作为一只投资于中创 400 指数的被动投资管理产品，我们将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，力争进一步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。期望中创 400ETF 将为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置，在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。重点支持创新业务和新产品拓展。创新是公司永恒的主题，同时应有效防控风险，从战略规划到具体产品方案，在投资范围、投资工具、运作规则的创新，使之更加符合投资者需求。

(2) 合规管理：主要从事前合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

(3) 内部审计：按季度对销售、投资、后台和其它业务开展内审，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。继续发起公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证，全面完成公司及基金的外审等。

(4) 法律事务：除了创新业务的法律支持外，还完成了大量的日常法律事务工作，包括合同、协议审查(包括各类产品及业务)，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理，继续完善公司整体风险架构表，推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制，努力实现适当风险水平下的效益最大化。

此外，我们还积极配合监管机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成季度、年度监察稽核报告和各项专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以

及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同十七（二）“1、在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率。基金净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%。基金管理人将以此计算截至收益评价日基金净值增长率与标的指数增长率的差额，当差额超过 1%时，基金管理人有权进行收益分配。”。报告期内，基金净值增长率与标的指数增长率的差额未超过 1%，因此本基金报告期内未实施利润分配，符合基金合同的约定。

4.9 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，本基金托管人在对中创 400 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，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，中创 400 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在中创 400 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、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，中创 400 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年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 审计报告

普华永道中天审字(2016)第 20310 号

中创 400 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的中创 400 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实中创 400ETF 基金”)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

一、 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是嘉实中创 400ETF 基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映;
- (2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

二、 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为，上述嘉实中创 400ETF 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了嘉实中创 400ETF 基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天

注册会计师

会计师事务所(特殊普通合伙)

许 康 玮

中国 · 上海市

洪 磊

2016 年 3 月 18 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	1,675,294.88	2,891,323.88

结算备付金		232,372.66	22,527.39
存出保证金		31,889.82	2,477.88
交易性金融资产	7.4.7.2	170,685,191.45	117,365,397.50
其中：股票投资		170,685,191.45	117,365,397.50
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	298.75	522.49
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		172,625,047.56	120,282,249.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		21,925.95	162,412.16
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		72,638.62	60,733.12
应付托管费		14,527.75	12,146.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	16,017.76	8,914.03
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	285,000.00	554,131.31
负债合计		410,110.08	798,337.25
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	67,561,264.00	76,561,264.00
未分配利润	7.4.7.10	104,653,673.48	42,922,647.89
所有者权益合计		172,214,937.48	119,483,911.89
负债和所有者权益总计		172,625,047.56	120,282,249.14

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.5490 元，基金份额总额 67,561,264.00 份。

7.2 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		26,371,827.20	26,164,246.55
1.利息收入		22,001.74	11,753.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	22,001.74	11,747.75
债券利息收入		-	5.39
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		20,642,000.40	28,511,358.48
其中：股票投资收益	7.4.7.12	20,119,329.73	27,651,296.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	731.71
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	522,670.67	859,330.45
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	5,107,772.13	-2,515,900.04
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	600,052.93	157,034.97
减：二、费用		1,861,042.04	1,648,808.96
1. 管理人报酬		807,724.12	693,072.95
2. 托管费		161,544.95	138,614.64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	321,440.97	96,361.87
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	570,332.00	720,759.50
三、利润总额		24,510,785.16	24,515,437.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润		24,510,785.16	24,515,437.59

7.3 所有者权益（基金净值）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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	76,561,264.00	42,922,647.89	119,483,911.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,510,785.16	24,510,785.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-9,000,000.00	37,220,240.43	28,220,240.43
其中：1.基金申购款	102,000,000.00	171,641,086.13	273,641,086.13
2.基金赎回款	-111,000,000.00	-134,420,845.70	-245,420,845.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	67,561,264.00	104,653,673.48	172,214,937.48
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	73,561,264.00	20,197,401.17	93,758,665.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,515,437.59	24,515,437.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	3,000,000.00	-1,790,190.87	1,209,809.13
其中：1.基金申购款	71,000,000.00	39,519,835.01	110,519,835.01
2.基金赎回款	-68,000,000.00	-41,310,025.88	-109,310,025.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	76,561,264.00	42,922,647.89	119,483,911.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

赵学军

基金管理人负责人

王红

主管会计工作负责人

常旭

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 286,543,155.00 元(含募集股票市值),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 066 号验资报告予以验证。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,其中认购资金利息折合 18,109.00 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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2012]117 号文审核同意,本基金 286,561,264.00 份基金份额于 2012 年 5 月 11 日在深交所挂牌交易。

根据《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》的有关规定,本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股,投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。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、创业板及其他中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证等)、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)。本基金的标的指数及业绩比较基准为中创 400 指数。

本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“嘉实中创 400ETF 联接基金”)。嘉实中创 400ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

7.4.2 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》、《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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括

卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，

参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的

预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人有权进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 6 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。本基金收益分配采取现金方式。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有

限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
活期存款	1,675,294.88	2,891,323.88
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,675,294.88	2,891,323.88

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	151,554,732.44	170,685,191.45	19,130,459.01
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	151,554,732.44	170,685,191.45	19,130,459.01
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	103,342,710.62	117,365,397.50	14,022,686.88
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	103,342,710.62	117,365,397.50	14,022,686.88

注：股票投资的公允价值和股票投资的估值增值均包含可退替代款的估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2015 年 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2015 年 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2015 年 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	272.32	462.60
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	12.03	58.79
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	14.40	1.10
合计	298.75	522.49

7.4.7.6 其他资产

本期末（2015 年 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	16,017.76	8,914.03
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	16,017.76	8,914.03

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	210,000.00	360,000.00
应付指数使用费	75,000.00	75,000.00
应付替代款	-	36,665.10
可退替代款	-	82,466.21
其他	-	-
合计	285,000.00	554,131.31

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	76,561,264.00	76,561,264.00
本期申购	102,000,000.00	102,000,000.00
本期赎回	-111,000,000.00	-111,000,000.00
本期末	67,561,264.00	67,561,264.00

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	38,480,009.26	4,442,638.63	42,922,647.89
本期利润	19,403,013.03	5,107,772.13	24,510,785.16
本期基金份额交易产生的变动数	-957,766.61	38,178,007.04	37,220,240.43
其中：基金申购款	83,918,494.51	87,722,591.62	171,641,086.13
基金赎回款	-84,876,261.12	-49,544,584.58	-134,420,845.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,925,255.68	47,728,417.80	104,653,673.48

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	16,939.54	10,527.81
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	4,830.78	1,190.67
其他	231.42	29.27
合计	22,001.74	11,747.75

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	141,285.46	6,399,332.92
股票投资收益——赎回差价收入	19,978,044.27	21,251,963.40
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	20,119,329.73	27,651,296.32

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	120,129,727.11	32,571,722.71
减：卖出股票成本总额	119,988,441.65	26,172,389.79
买卖股票差价收入	141,285.46	6,399,332.92

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
赎回基金份额对价总额	245,420,845.70	109,310,025.88
减：现金支付赎回款总额	39,429,873.70	3,461,598.88
减：赎回股票成本总额	186,012,927.73	84,596,463.60
赎回差价收入	19,978,044.27	21,251,963.40

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	-	24,137.10
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	-	23,400.00
减：应收利息总额	-	5.39
买卖债券差价收入	-	731.71

注：本期（2015年1月1日至2015年12月31日），本基金无债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本期（2015年1月1日至2015年12月31日）及上年度可比期间（2014年1月1日至2014年12月31日），本基金无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
股票投资产生的股利收益	522,670.67	859,330.45
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	522,670.67	859,330.45

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015 年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
1. 交易性金融资产	5,107,772.13	-2,515,900.04
——股票投资	5,107,772.13	-2,515,900.04
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-

3. 其他	-	-
合计	5,107,772.13	-2,515,900.04

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	600,052.93	157,034.97
其他	-	-
合计	600,052.93	157,034.97

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31 日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
交易所市场交易费用	321,440.97	96,361.87
银行间市场交易费用	-	-
合计	321,440.97	96,361.87

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	150,000.00	300,000.00
债券托管账户维护费	-	-
银行划款手续费	332.00	359.50
指数使用费	300,000.00	300,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
红利手续费	-	-
其他	-	400.00
合计	570,332.00	720,759.50

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
嘉实中创 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

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	807,724.12	693,072.95
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：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 0.5% 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 × 0.5% / 当年天数。

7.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	161,544.95	138,614.64

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%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×0.1% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2015年1月1日至2015年12月31日）及上年度可比期间（2014年1月1日至2014年12月31日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

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

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2015年12月31日		2014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	62,684,808.00	92.78%	70,653,408.00	92.28%

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,675,294.88	16,939.54	2,891,323.88	10,527.81

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按适用利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日），本基金未实施利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 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
002018	华信国际	2015 年 6 月 15 日	重大事项 停牌	44.08	-	-	49,520	1,228,175.65	2,182,841.60	-
002020	京新药业	2015 年 12 月 29 日	重大事项 停牌	33.55	2016 年 1 月 20 日	30.20	13,196	272,555.21	442,725.80	-
002143	印纪传媒	2015 年 12 月 9 日	重大事项 停牌	40.55	2016 年 1 月 5 日	36.50	4,000	132,180.32	162,200.00	-
002174	游族网络	2015 年 7 月 23 日	重大事项 停牌	89.53	2016 年 2 月 15 日	80.58	5,096	437,373.00	456,244.88	-
002235	安妮股份	2015 年 7 月 2 日	重大事项 停牌	29.10	2016 年 1 月 12 日	32.00	11,400	309,932.17	331,740.00	-
002239	奥特佳	2015 年 5 月 25 日	重大事项 停牌	18.32	2016 年 1 月 5 日	16.49	17,370	128,200.97	318,218.40	-
002240	威华股份	2015 年 12 月 25 日	重大事项 停牌	13.68	2016 年 1 月 22 日	12.31	20,076	308,794.12	274,639.68	-
002242	九阳股份	2015 年 12 月 24 日	重大事项 停牌	22.68	2016 年 1 月 11 日	20.41	18,000	355,801.76	408,240.00	-
002306	*ST 云网	2015 年 6 月 3 日	重大事项 停牌	9.22	2016 年 1 月 12 日	8.76	45,316	321,898.63	417,813.52	-
002313	日海通讯	2015 年 8 月 10 日	重大事项 停牌	14.80	2016 年 1 月 22 日	13.90	17,889	270,800.32	264,757.20	-
002371	七星电子	2015 年 10 月 8 日	重大事项 停牌	19.28	2016 年 1 月 11 日	21.21	11,568	346,529.80	223,031.04	-
002379	鲁丰环保	2015 年 10 月 22 日	重大事项 停牌	4.34	-	-	42,500	237,699.36	184,450.00	-
002481	双塔食品	2015 年 7 月 7 日	重大事项 停牌	13.88	2016 年 1 月 4 日	12.49	45,485	528,071.94	631,331.80	-

002542	中化岩土	2015年12月28日	重大事项停牌	13.59	-	-	500	6,710.00	6,795.00	-
002544	杰赛科技	2015年8月31日	重大事项停牌	29.65	-	-	17,384	501,952.00	515,435.60	-
002622	永大集团	2015年7月2日	重大事项停牌	25.28	2016年1月8日	27.81	25,500	692,560.35	644,640.00	-
002638	勤上光电	2015年8月31日	重大事项停牌	15.32	2016年1月19日	16.85	16,400	303,091.44	251,248.00	-
002664	信质电机	2015年12月30日	重大事项停牌	31.77	2016年3月8日	28.59	11,600	346,649.45	368,532.00	-
002678	珠江钢琴	2015年12月21日	重大事项停牌	17.21	2016年1月19日	15.49	11,400	191,208.88	196,194.00	-
002698	博实股份	2015年12月28日	重大事项停牌	29.33	2016年1月5日	26.40	12,516	318,528.60	367,094.28	-
300010	立思辰	2015年12月30日	重大事项停牌	31.90	2016年1月8日	28.71	24,079	619,960.47	768,120.10	-
300011	鼎汉技术	2015年12月31日	重大事项停牌	29.80	2016年1月22日	26.82	15,600	524,371.38	464,880.00	-
300028	金亚科技	2015年6月9日	重大事项停牌	34.51	-	-	25,870	707,692.39	892,773.70	-
300043	互动娱乐	2015年12月17日	重大事项停牌	15.80	-	-	36,340	495,569.81	574,172.00	-
300054	鼎龙股份	2015年11月23日	重大事项停牌	24.66	2016年3月14日	22.19	18,005	394,572.90	444,003.30	-
300088	长信科技	2015年12月14日	重大事项停牌	14.03	2016年2月29日	12.63	53,900	701,725.25	756,217.00	-
300197	铁汉生态	2015年12月30日	重大事项停牌	17.11	2016年1月7日	16.59	20,892	305,532.78	357,462.12	-
300238	冠昊生物	2015年11月12日	重大事项停牌	56.67	-	-	12,000	431,752.43	680,040.00	-
300323	华灿光电	2015年12月29日	重大事项停牌	10.18	2016年1月4日	10.20	19,150	144,512.25	194,947.00	-
300324	旋极信息	2015年12月1日	重大事项停牌	49.25	2016年3月10日	44.33	14,500	389,172.10	714,125.00	-
300336	新文化	2015年12月24日	重大事项停牌	42.00	-	-	11,167	269,473.86	469,014.00	-
300355	蒙草抗旱	2015年12月14日	重大事项停牌	17.84	2016年2月16日	16.06	15,700	289,183.14	280,088.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

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

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为

所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金未持有债券投资(上年度末：无)。

7.4.13.3 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对兑付申购赎回产生的退补款、现金替代款和现金差额的流动性风险，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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本报告期末，除附注 7.4.12.3 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	1,675,294.88	-	-	-	1,675,294.88
结算备付金	232,372.66	-	-	-	232,372.66
存出保证金	31,889.82	-	-	-	31,889.82
交易性金融资产	-	-	-	170,685,191.45	170,685,191.45
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	-	-	-	298.75	298.75
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,939,557.36	-	-	170,685,490.20	172,625,047.56
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	-	-	-	21,925.95	21,925.95
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	72,638.62	72,638.62
应付托管费	-	-	-	14,527.75	14,527.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	16,017.76	16,017.76
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	285,000.00	285,000.00
负债总计	-	-	-	410,110.08	410,110.08
利率敏感度缺口	1,939,557.36	-	-	170,275,380.12	172,214,937.48
上年度末 2014 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	2,891,323.88	-	-	-	2,891,323.88
结算备付金	22,527.39	-	-	-	22,527.39

存出保证金	2,477.88	-	-	-	2,477.88
交易性金融资产	-	-	-	117,365,397.50	117,365,397.50
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	-	-	-	522.49	522.49
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,916,329.15	-	-	117,365,919.99	120,282,249.14
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	-	-	-	162,412.16	162,412.16
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	60,733.12	60,733.12
应付托管费	-	-	-	12,146.63	12,146.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	8,914.03	8,914.03
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	554,131.31	554,131.31
负债总计	-	-	-	798,337.25	798,337.25
利率敏感度缺口	2,916,329.15	-	-	116,567,582.74	119,483,911.89

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2014 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数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。

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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014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	170,685,191.45	99.11	117,365,397.50	98.23
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	170,685,191.45	99.11	117,365,397.50	98.23

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2015年12月)	上年度末(2014年12月)

		31 日)	31 日)
	业绩比较基准上升 5%	8,357,982.70	5,935,819.09
	业绩比较基准下降 5%	-8,357,982.70	-5,935,819.09

7.4.13.4.4 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。

7.4.14 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 155,441,176.43 元，属于第二层次的余额为 15,244,015.02 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 102,224,973.23 元，第二层次 15,140,424.27 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本基金于 2015 年 3 月 31 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值（附注 7.4.5.2），并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	170,685,191.45	98.88
	其中：股票	170,685,191.45	98.88
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,907,667.54	1.11
7	其他各项资产	32,188.57	0.02
	合计	172,625,047.56	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,595,718.79	1.51
B	采矿业	1,210,892.40	0.70
C	制造业	122,867,221.14	71.35

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,099,838.12	0.64
E	建筑业	3,887,811.95	2.26
F	批发和零售业	3,554,713.40	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	599,473.16	0.35
H	住宿和餐饮业	182,390.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,478,271.76	14.79
J	金融业	-	-
K	房地产业	982,717.59	0.57
L	租赁和商务服务业	1,442,251.15	0.84
M	科学研究和技术服务业	1,650,162.38	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	719,226.75	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,705,376.94	0.99
R	文化、体育和娱乐业	1,973,094.00	1.15
S	综合	-	-
	合计	169,949,159.53	98.68

8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	318,218.40	0.18
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	417,813.52	0.24
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		-
O	居民服务、修理和其他服务业		-
P	教育		-
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业		-
S	综合		-
	合计	736,031.92	0.43

8.3 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

8.3.1 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	占基金资产净值比例（%）
1	002018	华信国际	49,520	2,182,841.60	1.27
2	002466	天齐锂业	9,630	1,355,422.50	0.79
3	002681	奋达科技	26,500	1,158,050.00	0.67
4	300113	顺网科技	10,391	1,053,335.67	0.61
5	002460	赣锋锂业	15,320	964,087.60	0.56
6	002407	多氟多	12,382	944,251.32	0.55
7	002368	太极股份	13,808	926,516.80	0.54
8	300028	金亚科技	25,870	892,773.70	0.52
9	002308	威创股份	35,543	876,134.95	0.51
10	002268	卫士通	15,582	875,864.22	0.51
11	300142	沃森生物	66,040	870,407.20	0.51
12	002085	万丰奥威	25,722	827,733.96	0.48
13	300001	特锐德	28,374	822,846.00	0.48
14	300156	神雾环保	16,398	819,736.02	0.48
15	002176	江特电机	44,692	786,579.20	0.46
16	002161	远望谷	35,200	784,960.00	0.46
17	300267	尔康制药	23,200	779,520.00	0.45

18	002131	利欧股份	39,474	769,743.00	0.45
19	300010	立思辰	24,079	768,120.10	0.45
20	002491	通鼎互联	39,300	761,634.00	0.44
21	300088	长信科技	53,900	756,217.00	0.44
22	300207	欣旺达	26,588	747,122.80	0.43
23	300367	东方网力	10,700	745,790.00	0.43
24	300147	香雪制药	29,266	731,942.66	0.43
25	300216	千山药机	16,600	731,728.00	0.42
26	002489	浙江永强	66,949	725,727.16	0.42
27	002273	水晶光电	17,700	718,620.00	0.42
28	300324	旋极信息	14,500	714,125.00	0.41
29	300287	飞利信	39,000	705,900.00	0.41
30	300182	捷成股份	29,150	699,600.00	0.41
31	300257	开山股份	22,600	697,210.00	0.40
32	300020	银江股份	28,321	694,430.92	0.40
33	002665	首航节能	22,700	692,350.00	0.40
34	300271	华宇软件	14,505	688,697.40	0.40
35	002467	二六三	32,756	687,548.44	0.40
36	300166	东方国信	21,336	683,392.08	0.40
37	300238	冠昊生物	12,000	680,040.00	0.39
38	002508	老板电器	14,977	673,216.15	0.39
39	300274	阳光电源	24,500	671,790.00	0.39
40	002563	森马服饰	54,000	669,600.00	0.39
41	300291	华录百纳	18,747	667,393.20	0.39
42	300203	聚光科技	19,400	665,226.00	0.39
43	002089	新海宜	29,379	661,321.29	0.38
44	002123	荣信股份	25,573	655,947.45	0.38
45	002390	信邦制药	45,300	650,055.00	0.38
46	002055	得润电子	16,772	648,405.52	0.38
47	002070	众和股份	29,534	645,022.56	0.37
48	002622	永大集团	25,500	644,640.00	0.37
49	002572	索菲亚	14,800	637,880.00	0.37
50	300015	爱尔眼科	20,175	637,126.50	0.37
51	300009	安科生物	14,721	637,124.88	0.37
52	002690	美亚光电	15,700	633,495.00	0.37
53	002439	启明星辰	19,732	631,424.00	0.37
54	002481	双塔食品	45,485	631,331.80	0.37
55	002002	鸿达兴业	24,200	630,894.00	0.37
56	300159	新研股份	37,700	625,820.00	0.36

57	002224	三力士	27,700	601,644.00	0.35
58	002299	圣农发展	27,300	600,327.00	0.35
59	002630	华西能源	40,560	599,071.20	0.35
60	002276	万马股份	19,860	597,786.00	0.35
61	002185	华天科技	33,206	595,383.58	0.35
62	002013	中航机电	26,243	594,666.38	0.35
63	002384	东山精密	29,700	594,594.00	0.35
64	300115	长盈精密	17,300	580,761.00	0.34
65	002215	诺普信	30,165	578,564.70	0.34
66	300208	恒顺众昇	23,800	578,340.00	0.34
67	002067	景兴纸业	64,531	576,261.83	0.33
68	300297	蓝盾股份	27,652	575,438.12	0.33
69	300043	互动娱乐	36,340	574,172.00	0.33
70	300212	易华录	12,397	572,369.49	0.33
71	002474	榕基软件	23,888	572,117.60	0.33
72	002117	东港股份	12,256	564,021.12	0.33
73	002444	巨星科技	27,100	560,970.00	0.33
74	002261	拓维信息	14,400	560,160.00	0.33
75	002550	千红制药	25,176	556,389.60	0.32
76	002074	国轩高科	14,989	556,091.90	0.32
77	002050	三花股份	51,944	553,203.60	0.32
78	300014	亿纬锂能	16,802	551,441.64	0.32
79	002642	荣之联	9,494	549,607.66	0.32
80	300352	北信源	8,800	549,120.00	0.32
81	300178	腾邦国际	18,780	546,498.00	0.32
82	002555	顺荣三七	11,130	543,811.80	0.32
83	002595	豪迈科技	23,940	543,198.60	0.32
84	300244	迪安诊断	7,800	542,412.00	0.32
85	002318	久立特材	35,228	538,988.40	0.31
86	002283	天润曲轴	24,077	537,398.64	0.31
87	300068	南都电源	27,075	537,168.00	0.31
88	002588	史丹利	16,430	534,467.90	0.31
89	002052	同洲电子	36,368	532,791.20	0.31
90	002019	亿帆鑫富	13,300	532,000.00	0.31
91	002130	沃尔核材	23,080	528,993.60	0.31
92	300347	泰格医药	17,106	525,838.44	0.31
93	002373	千方科技	11,400	521,550.00	0.30
94	002544	杰赛科技	17,384	515,435.60	0.30
95	300090	盛运环保	43,980	515,005.80	0.30

96	300032	金龙机电	16,890	513,456.00	0.30
97	002672	东江环保	25,275	509,796.75	0.30
98	002583	海能达	40,790	509,467.10	0.30
99	002303	美盈森	37,300	509,145.00	0.30
100	300202	聚龙股份	15,700	505,383.00	0.29
101	002443	金洲管道	28,332	503,742.96	0.29
102	002095	生意宝	6,820	501,883.80	0.29
103	002325	洪涛股份	31,826	497,440.38	0.29
104	002421	达实智能	22,660	496,254.00	0.29
105	002376	新北洋	26,797	495,208.56	0.29
106	002512	达华智能	21,850	493,810.00	0.29
107	002396	星网锐捷	20,393	492,490.95	0.29
108	300252	金信诺	12,100	488,840.00	0.28
109	002551	尚荣医疗	14,812	488,351.64	0.28
110	002023	海特高新	26,580	487,477.20	0.28
111	300171	东富龙	16,256	487,354.88	0.28
112	002271	东方雨虹	24,942	487,117.26	0.28
113	002269	美邦服饰	71,800	481,778.00	0.28
114	002366	台海核电	7,300	481,435.00	0.28
115	300288	朗玛信息	7,794	481,045.68	0.28
116	002138	顺络电子	33,494	480,638.90	0.28
117	002280	联络互动	7,800	478,920.00	0.28
118	002603	以岭药业	26,300	476,819.00	0.28
119	300359	全通教育	5,500	473,660.00	0.28
120	300075	数字政通	15,100	473,385.00	0.27
121	002121	科陆电子	15,989	473,274.40	0.27
122	002714	牧原股份	10,000	470,700.00	0.27
123	300336	新文化	11,167	469,014.00	0.27
124	002197	证通电子	17,572	468,820.96	0.27
125	300101	振芯科技	15,848	467,674.48	0.27
126	300011	鼎汉技术	15,600	464,880.00	0.27
127	002285	世联行	28,491	462,408.93	0.27
128	300045	华力创通	18,900	462,294.00	0.27
129	002174	游族网络	5,096	456,244.88	0.26
130	002477	雏鹰农牧	26,929	455,369.39	0.26
131	002179	中航光电	11,980	454,760.80	0.26
132	002522	浙江众成	24,500	453,985.00	0.26
133	300245	天玑科技	10,750	451,822.50	0.26
134	300039	上海凯宝	32,444	449,673.84	0.26

135	002037	久联发展	16,183	449,240.08	0.26
136	002345	潮宏基	26,594	448,906.72	0.26
137	300012	华测检测	18,200	447,538.00	0.26
138	002170	芭田股份	34,084	447,182.08	0.26
139	002339	积成电子	18,308	446,715.20	0.26
140	002463	沪电股份	68,954	445,442.84	0.26
141	300054	鼎龙股份	18,005	444,003.30	0.26
142	002020	京新药业	13,196	442,725.80	0.26
143	300053	欧比特	10,771	438,918.25	0.25
144	002288	超华科技	37,484	437,813.12	0.25
145	300339	润和软件	9,100	436,982.00	0.25
146	002497	雅化集团	49,978	436,807.72	0.25
147	002099	海翔药业	18,286	436,121.10	0.25
148	002249	大洋电机	32,888	436,094.88	0.25
149	002108	沧州明珠	24,590	434,505.30	0.25
150	002254	泰和新材	27,340	434,432.60	0.25
151	002091	江苏国泰	16,300	433,091.00	0.25
152	002358	森源电气	23,312	430,106.40	0.25
153	300122	智飞生物	11,800	429,284.00	0.25
154	300005	探路者	18,744	429,237.60	0.25
155	002025	航天电器	16,504	428,938.96	0.25
156	002482	广田股份	14,605	427,196.25	0.25
157	300111	向日葵	64,739	425,982.62	0.25
158	002448	中原内配	29,800	424,948.00	0.25
159	300284	苏交科	19,600	424,928.00	0.25
160	002028	思源电气	26,600	422,674.00	0.25
161	300047	天源迪科	14,500	421,950.00	0.25
162	002217	合力泰	24,600	416,970.00	0.24
163	002367	康力电梯	24,734	414,789.18	0.24
164	002154	报喜鸟	54,460	414,440.60	0.24
165	002094	青岛金王	13,279	413,640.85	0.24
166	002436	兴森科技	21,476	413,413.00	0.24
167	002244	滨江集团	51,900	413,124.00	0.24
168	300295	三六五网	8,312	412,275.20	0.24
169	002426	胜利精密	15,800	411,116.00	0.24
170	002029	七匹狼	30,000	410,100.00	0.24
171	002242	九阳股份	18,000	408,240.00	0.24
172	002168	深圳惠程	34,473	407,815.59	0.24
173	002031	巨轮智能	24,470	406,691.40	0.24

174	002527	新时达	18,450	405,715.50	0.24
175	002298	中电鑫龙	21,100	405,331.00	0.24
176	300065	海兰信	10,600	404,920.00	0.24
177	002581	未名医药	11,600	403,332.00	0.23
178	002424	贵州百灵	15,684	402,451.44	0.23
179	002177	御银股份	37,002	401,471.70	0.23
180	002470	金正大	19,518	396,996.12	0.23
181	002479	富春环保	29,501	395,313.40	0.23
182	300332	天壕环境	16,000	390,400.00	0.23
183	002309	中利科技	20,784	390,323.52	0.23
184	002342	巨力索具	51,100	388,871.00	0.23
185	002151	北斗星通	7,451	388,793.18	0.23
186	300131	英唐智控	16,500	387,915.00	0.23
187	002658	雪迪龙	14,249	387,430.31	0.23
188	002574	明牌珠宝	18,200	386,568.00	0.22
189	002245	澳洋顺昌	38,578	386,551.56	0.22
190	002414	高德红外	12,686	386,542.42	0.22
191	300157	恒泰艾普	31,650	386,446.50	0.22
192	300135	宝利国际	43,686	386,184.24	0.22
193	002041	登海种业	22,900	385,865.00	0.22
194	300004	南风股份	14,504	385,661.36	0.22
195	002657	中科金财	4,800	383,952.00	0.22
196	002296	辉煌科技	17,920	383,129.60	0.22
197	300228	富瑞特装	12,200	380,640.00	0.22
198	300152	科融环境	33,900	380,019.00	0.22
199	002334	英威腾	33,532	379,246.92	0.22
200	002263	大东南	38,853	378,816.75	0.22
201	300229	拓尔思	12,034	377,867.60	0.22
202	002178	延华智能	28,468	377,485.68	0.22
203	300096	易联众	14,129	376,820.43	0.22
204	002650	加加食品	46,350	376,362.00	0.22
205	002317	众生药业	28,200	373,368.00	0.22
206	002431	棕榈园林	13,901	373,102.84	0.22
207	300137	先河环保	17,700	370,815.00	0.22
208	002389	南洋科技	18,182	370,549.16	0.22
209	300183	东软载波	13,714	369,866.58	0.21
210	002664	信质电机	11,600	368,532.00	0.21
211	002093	国脉科技	24,700	367,536.00	0.21
212	002698	博实股份	12,516	367,094.28	0.21

213	002577	雷柏科技	6,400	366,208.00	0.21
214	002253	川大智胜	6,860	365,638.00	0.21
215	002262	恩华药业	12,420	363,533.40	0.21
216	002655	共达电声	14,737	363,414.42	0.21
217	300269	联建光电	12,100	362,274.00	0.21
218	002332	仙琚制药	23,812	360,751.80	0.21
219	002064	华峰氨纶	55,500	360,195.00	0.21
220	002056	横店东磁	12,800	359,808.00	0.21
221	002221	东华能源	15,388	359,771.44	0.21
222	002564	天沃科技	29,500	359,310.00	0.21
223	002556	辉隆股份	19,396	358,632.04	0.21
224	002411	九九久	17,879	358,473.95	0.21
225	300197	铁汉生态	20,892	357,462.12	0.21
226	002256	彩虹精化	13,368	357,326.64	0.21
227	002009	天奇股份	17,200	356,900.00	0.21
228	300226	上海钢联	6,996	354,697.20	0.21
229	002277	友阿股份	25,400	352,806.00	0.20
230	002214	大立科技	22,200	352,536.00	0.20
231	002496	辉丰股份	12,444	352,165.20	0.20
232	300408	三环集团	9,400	350,432.00	0.20
233	002663	普邦园林	43,954	348,994.76	0.20
234	002229	鸿博股份	11,700	348,192.00	0.20
235	300118	东方日升	23,848	347,465.36	0.20
236	002281	光迅科技	5,304	343,858.32	0.20
237	002097	山河智能	31,691	343,530.44	0.20
238	002640	跨境通	10,300	342,990.00	0.20
239	002480	新筑股份	26,788	342,886.40	0.20
240	002476	宝莫股份	34,200	341,316.00	0.20
241	300128	锦富新材	13,391	339,327.94	0.20
242	002237	恒邦股份	33,900	338,322.00	0.20
243	300364	中文在线	1,900	338,200.00	0.20
244	002021	中捷资源	27,720	336,798.00	0.20
245	002078	太阳纸业	59,804	336,696.52	0.20
246	002118	紫鑫药业	17,201	335,591.51	0.19
247	002447	壹桥海参	34,776	335,588.40	0.19
248	002156	通富微电	17,557	335,163.13	0.19
249	002604	龙力生物	22,643	335,116.40	0.19
250	300369	绿盟科技	6,850	333,184.00	0.19
251	300185	通裕重工	36,224	332,898.56	0.19

252	002235	安妮股份	11,400	331,740.00	0.19
253	300064	豫金刚石	24,106	331,698.56	0.19
254	300074	华平股份	22,479	331,340.46	0.19
255	002521	齐峰新材	26,500	331,250.00	0.19
256	002433	太安堂	22,273	330,976.78	0.19
257	002540	亚太科技	32,700	326,346.00	0.19
258	002126	银轮股份	17,667	325,956.15	0.19
259	002327	富安娜	27,034	325,219.02	0.19
260	002071	长城影视	18,200	323,050.00	0.19
261	002079	苏州固锔	29,607	323,012.37	0.19
262	300006	莱美药业	8,049	321,960.00	0.19
263	002293	罗莱生活	17,650	321,936.00	0.19
264	002100	天康生物	31,640	318,298.40	0.18
265	002210	飞马国际	14,595	317,733.15	0.18
266	002259	升达林业	29,126	317,473.40	0.18
267	002233	塔牌集团	21,577	316,103.05	0.18
268	300205	天喻信息	15,188	313,480.32	0.18
269	002122	天马股份	37,600	313,208.00	0.18
270	002565	上海绿新	25,972	310,365.40	0.18
271	300056	三维丝	14,380	310,176.60	0.18
272	002148	北纬通信	13,596	310,124.76	0.18
273	300316	晶盛机电	21,100	309,115.00	0.18
274	002111	威海广泰	10,154	308,173.90	0.18
275	002526	山东矿机	26,464	307,511.68	0.18
276	300150	世纪瑞尔	21,192	307,284.00	0.18
277	002115	三维通信	19,350	307,084.50	0.18
278	300224	正海磁材	13,202	305,758.32	0.18
279	300034	钢研高纳	11,646	305,125.20	0.18
280	300052	中青宝	10,500	304,395.00	0.18
281	002432	九安医疗	12,288	303,513.60	0.18
282	002083	孚日股份	37,894	303,152.00	0.18
283	002440	闰土股份	15,892	302,742.60	0.18
284	002408	齐翔腾达	22,687	301,963.97	0.18
285	002628	成都路桥	40,524	301,903.80	0.18
286	002449	国星光电	17,700	299,130.00	0.17
287	300177	中海达	15,580	298,824.40	0.17
288	300071	华谊嘉信	20,800	295,360.00	0.17
289	002251	步步高	18,009	293,546.70	0.17
290	002503	搜于特	18,436	292,026.24	0.17

291	002605	姚记扑克	11,300	291,653.00	0.17
292	002600	江粉磁材	25,000	290,500.00	0.17
293	002341	新纶科技	17,312	288,244.80	0.17
294	300263	隆华节能	9,900	286,110.00	0.17
295	002369	卓翼科技	21,382	284,380.60	0.17
296	300181	佐力药业	23,912	284,313.68	0.17
297	002203	海亮股份	25,800	283,800.00	0.16
298	002697	红旗连锁	36,770	283,496.70	0.16
299	002454	松芝股份	14,728	282,630.32	0.16
300	002297	博云新材	19,450	282,219.50	0.16
301	002362	汉王科技	8,800	282,040.00	0.16
302	002538	司尔特	22,300	281,203.00	0.16
303	300355	蒙草抗旱	15,700	280,088.00	0.16
304	300129	泰胜风能	30,100	279,328.00	0.16
305	002315	焦点科技	2,897	278,140.97	0.16
306	002157	正邦科技	13,719	275,751.90	0.16
307	002240	威华股份	20,076	274,639.68	0.16
308	002392	北京利尔	35,188	273,762.64	0.16
309	002610	爱康科技	22,500	272,700.00	0.16
310	002255	海陆重工	26,192	272,658.72	0.16
311	002337	赛象科技	26,400	271,656.00	0.16
312	300363	博腾股份	9,975	270,621.75	0.16
313	300392	腾信股份	6,700	268,134.00	0.16
314	002313	日海通讯	17,889	264,757.20	0.15
315	002140	东华科技	12,400	264,120.00	0.15
316	002363	隆基机械	11,500	262,775.00	0.15
317	002060	粤水电	27,692	255,320.24	0.15
318	002493	荣盛石化	16,400	254,200.00	0.15
319	300204	舒泰神	7,158	253,679.52	0.15
320	002232	启明信息	11,920	253,657.60	0.15
321	002017	东信和平	12,990	252,006.00	0.15
322	002638	勤上光电	16,400	251,248.00	0.15
323	002646	青青稞酒	11,000	251,020.00	0.15
324	002486	嘉麟杰	39,600	248,688.00	0.14
325	002401	中海科技	9,600	248,640.00	0.14
326	002571	德力股份	14,400	246,960.00	0.14
327	002469	三维工程	15,218	245,770.70	0.14
328	002635	安洁科技	8,800	244,640.00	0.14
329	002194	武汉凡谷	14,374	244,358.00	0.14

330	002307	北新路桥	21,642	244,121.76	0.14
331	002737	葵花药业	5,100	242,811.00	0.14
332	300139	晓程科技	13,500	242,595.00	0.14
333	300303	聚飞光电	20,820	241,095.60	0.14
334	002275	桂林三金	10,100	235,330.00	0.14
335	002069	獐子岛	17,200	234,952.00	0.14
336	300080	易成新能	21,814	234,936.78	0.14
337	300191	潜能恒信	5,299	233,685.90	0.14
338	002226	江南化工	25,722	232,269.66	0.13
339	300037	新宙邦	3,900	228,150.00	0.13
340	300307	慈星股份	13,994	224,743.64	0.13
341	300136	信维通信	7,600	224,580.00	0.13
342	300463	迈克生物	1,900	223,041.00	0.13
343	002371	七星电子	11,568	223,031.04	0.13
344	300155	安居宝	12,300	221,400.00	0.13
345	002216	三全食品	19,384	220,783.76	0.13
346	002354	天神娱乐	2,300	220,754.00	0.13
347	002204	大连重工	21,732	217,320.00	0.13
348	002711	欧浦智网	6,080	212,921.60	0.12
349	300105	龙源技术	18,932	212,038.40	0.12
350	002510	天汽模	11,900	210,987.00	0.12
351	002080	中材科技	7,900	210,298.00	0.12
352	300187	永清环保	3,900	209,430.00	0.12
353	300337	银邦股份	22,900	208,848.00	0.12
354	002419	天虹商场	15,400	207,900.00	0.12
355	002032	苏泊尔	7,292	202,863.44	0.12
356	300386	飞天诚信	4,040	199,778.00	0.12
357	002322	理工监测	7,880	199,127.60	0.12
358	002267	陕天然气	15,800	199,080.00	0.12
359	002678	珠江钢琴	11,400	196,194.00	0.11
360	300323	华灿光电	19,150	194,947.00	0.11
361	002618	丹邦科技	3,995	194,396.70	0.11
362	002462	嘉事堂	3,800	192,356.00	0.11
363	002227	奥特迅	4,840	191,180.00	0.11
364	002393	力生制药	3,900	188,370.00	0.11
365	300199	翰宇药业	7,600	187,188.00	0.11
366	300078	思创医惠	3,800	185,440.00	0.11
367	002379	鲁丰环保	42,500	184,450.00	0.11
368	300333	兆日科技	3,800	182,400.00	0.11

369	002186	全聚德	7,930	182,390.00	0.11
370	002166	莱茵生物	11,794	179,268.80	0.10
371	002128	露天煤业	21,200	179,140.00	0.10
372	002172	澳洋科技	11,881	176,789.28	0.10
373	300148	天舟文化	9,968	175,436.80	0.10
374	002378	章源钨业	14,400	173,376.00	0.10
375	002524	光正集团	15,800	167,480.00	0.10
376	300262	巴安水务	8,940	166,015.80	0.10
377	002488	金固股份	5,700	165,300.00	0.10
378	002143	印纪传媒	4,000	162,200.00	0.09
379	300026	红日药业	7,600	160,360.00	0.09
380	002326	永太科技	7,600	159,904.00	0.09
381	002311	海大集团	11,400	159,258.00	0.09
382	002329	皇氏集团	5,700	159,030.00	0.09
383	002155	湖南黄金	17,500	157,325.00	0.09
384	002012	凯恩股份	15,974	157,184.16	0.09
385	002284	亚太股份	7,600	157,168.00	0.09
386	002773	康弘药业	1,900	156,180.00	0.09
387	300377	赢时胜	1,900	156,123.00	0.09
388	002461	珠江啤酒	10,199	155,738.73	0.09
389	002601	佰利联	3,994	155,606.24	0.09
390	300215	电科院	7,800	154,440.00	0.09
391	002428	云南锗业	7,600	154,128.00	0.09
392	002626	金达威	7,900	153,339.00	0.09
393	002683	宏大爆破	11,900	151,725.00	0.09
394	002047	宝鹰股份	13,300	149,492.00	0.09
395	002429	兆驰股份	11,400	144,666.00	0.08
396	300348	长亮科技	1,900	144,001.00	0.08
397	300298	三诺生物	3,967	142,653.32	0.08
398	002372	伟星新材	7,912	141,466.56	0.08
399	002498	汉缆股份	19,000	141,360.00	0.08
400	002035	华帝股份	7,923	140,870.94	0.08
401	300406	九强生物	3,000	140,640.00	0.08
402	002716	金贵银业	11,860	139,355.00	0.08
403	002416	爱施德	7,900	138,250.00	0.08
404	002198	嘉应制药	11,800	129,092.00	0.08
405	002561	徐家汇	7,892	128,718.52	0.07
406	002279	久其软件	1,900	128,630.00	0.07
407	002182	云海金属	7,900	127,348.00	0.07

408	002106	莱宝高科	9,500	126,730.00	0.07
409	002547	春兴精工	9,500	126,160.00	0.07
410	002324	普利特	3,949	124,709.42	0.07
411	300300	汉鼎股份	3,800	124,298.00	0.07
412	002225	濮耐股份	15,860	121,329.00	0.07
413	002181	粤传媒	7,600	120,460.00	0.07
414	002700	新疆浩源	7,896	115,044.72	0.07
415	002437	誉衡药业	3,800	114,950.00	0.07
416	002505	大康牧业	13,300	112,917.00	0.07
417	002144	宏达高科	3,900	111,072.00	0.06
418	002364	中恒电气	3,800	107,198.00	0.06
419	002016	世荣兆业	7,922	107,184.66	0.06
420	002649	博彦科技	1,900	106,932.00	0.06
421	002457	青龙管业	7,850	105,190.00	0.06
422	002287	奇正藏药	2,500	103,950.00	0.06
423	002331	皖通科技	3,800	102,904.00	0.06
424	002554	惠博普	7,890	102,570.00	0.06
425	300231	银信科技	3,800	102,144.00	0.06
426	002484	江海股份	3,900	101,010.00	0.06
427	002107	沃华医药	3,800	98,534.00	0.06
428	002625	龙生股份	1,900	92,435.00	0.05
429	002430	杭氧股份	7,859	90,378.50	0.05
430	002490	山东墨龙	7,800	89,232.00	0.05
431	002180	艾派克	1,900	87,685.00	0.05
432	002648	卫星石化	7,900	85,399.00	0.05
433	002609	捷顺科技	3,800	79,268.00	0.05
434	300110	华仁药业	5,600	78,456.00	0.05
435	300439	美康生物	1,900	76,038.00	0.04
436	300413	快乐购	1,900	75,240.00	0.04
437	300248	新开普	1,900	70,585.00	0.04
438	002302	西部建设	3,915	69,765.30	0.04
439	002752	昇兴股份	1,900	66,500.00	0.04
440	300314	戴维医疗	1,900	64,657.00	0.04
441	002423	中原特钢	3,992	55,848.08	0.03
442	300276	三丰智能	1,900	48,374.00	0.03
443	002314	南山控股	5,700	48,279.00	0.03
444	002542	中化岩土	500	6,795.00	0.00

8.3.2 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	占基金资产净值比例（%）
1	002306	*ST 云网	45,316	417,813.52	0.24
2	002239	奥特佳	17,370	318,218.40	0.18

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002681	奋达科技	1,634,193.17	1.37
2	300159	新研股份	1,523,184.00	1.27
3	002269	美邦服饰	1,328,630.00	1.11
4	002273	水晶光电	1,223,392.46	1.02
5	002657	中科金财	1,195,648.52	1.00
6	002563	森马服饰	1,184,930.08	0.99
7	002466	天齐锂业	1,102,615.86	0.92
8	002572	索菲亚	1,017,907.54	0.85
9	002013	中航机电	1,014,971.70	0.85
10	002025	航天电器	1,011,159.82	0.85
11	002540	亚太科技	1,010,443.00	0.85
12	300088	长信科技	1,004,658.17	0.84
13	300216	千山药机	954,700.00	0.80
14	300359	全通教育	936,977.00	0.78
15	300011	鼎汉技术	931,178.00	0.78
16	002041	登海种业	925,271.50	0.77
17	002179	中航光电	921,807.00	0.77
18	300178	腾邦国际	916,459.80	0.77
19	002261	拓维信息	913,515.00	0.76
20	002244	滨江集团	845,515.90	0.71

8.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002312	三泰控股	2,112,644.88	1.77
2	300144	宋城演艺	1,691,773.54	1.42
3	002266	浙富控股	1,494,678.19	1.25
4	300170	汉得信息	1,432,416.83	1.20
5	002439	启明星辰	1,400,885.00	1.17
6	002573	清新环境	1,212,701.74	1.01
7	002501	利源精制	1,182,973.97	0.99
8	300055	万邦达	834,300.81	0.70
9	002424	贵州百灵	828,184.68	0.69
10	002681	奋达科技	825,890.80	0.69
11	002276	万马股份	814,996.41	0.68
12	002437	誉衡药业	802,191.00	0.67
13	002179	中航光电	786,192.01	0.66
14	300101	振芯科技	770,846.09	0.65
15	002440	闰土股份	718,928.63	0.60
16	300267	尔康制药	709,837.56	0.59
17	002396	星网锐捷	688,068.44	0.58
18	002050	三花股份	648,440.63	0.54
19	300244	迪安诊断	641,635.30	0.54
20	002168	深圳惠程	638,828.53	0.53

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	128,099,647.12
卖出股票收入（成交）总额	120,129,727.11

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

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

8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 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	31,889.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	298.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	32,188.57

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002018	华信国际	2,182,841.60	1.27	重大事项停牌
2	300028	金亚科技	892,773.70	0.52	重大事项停牌

8.12.5.2 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	002306	*ST 云网	417,813.52	0.24	重大事项停牌
2	002239	奥特佳	318,218.40	0.18	重大事项停牌

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的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
473	142,835.65	62,701,269.00	92.81%	4,859,995.00	7.19%

9.1.2 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 400ETF 联接	62,684,808.00	92.78%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 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	慎东明	364,999.00	0.54%
2	薛芸	250,800.00	0.37%
3	何凤珍	203,000.00	0.30%
4	李平曾	170,000.00	0.25%
5	马学清	145,026.00	0.21%
6	张凡	140,000.00	0.21%
7	王传宁	121,010.00	0.18%
8	徐隽婵	103,270.00	0.15%
9	谭惠玲	100,009.00	0.15%
10	李王秀	91,701.00	0.14%
	中国工商银行—中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	62,684,808.00	92.78%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	0.00%

9.4 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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研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

§ 10 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	76,561,264.00
本报告期基金总申购份额	102,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	111,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	67,561,264.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

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

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 60,000.00 元，该审计机构已连续 4 年提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
北京高华证券有限责任公司	2	185,008,371.55	74.57%	129,511.91	74.57%	-
海通证券股份有限公司	2	63,099,095.51	25.43%	44,172.55	25.43%	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 1 个
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融	1	-	-	-	-	-

有限公司						
中国银河证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限 公司	1	-	-	-	-	新增
长江证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增

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

注 2：交易单元的选择标准和程序

(1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；

(2) 公司财务状况良好；

(3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

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

(5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

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

注 3：申银万国证券股份有限公司更名为申万宏源证券有限公司。

注 4：国都证券有限责任公司更名为国都证券股份有限公司。

11.8 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	关于深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金、中创 400 交易型开放式指数证券投资基金的申购赎回清单新增申赎数量限制指标的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 31 日
2	关于增加中信建投证券股份有限公司为嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 24 日

§ 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

北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 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
2016 年 3 月 29 日