

# 中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 日

## §1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## §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	78,561,264.00 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。
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

## 2.4 信息披露方式

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

## §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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-1,692,232.37
本期利润	-24,244,484.19
加权平均基金份额本期利润	-0.3112
本期加权平均净值利润率	-15.63%
本期基金份额净值增长率	-15.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	64,526,100.52
期末可供分配基金份额利润	0.8213
期末基金资产净值	169,408,590.85
期末基金份额净值	2.1564
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	115.64%

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

### 3.2 基金净值表现

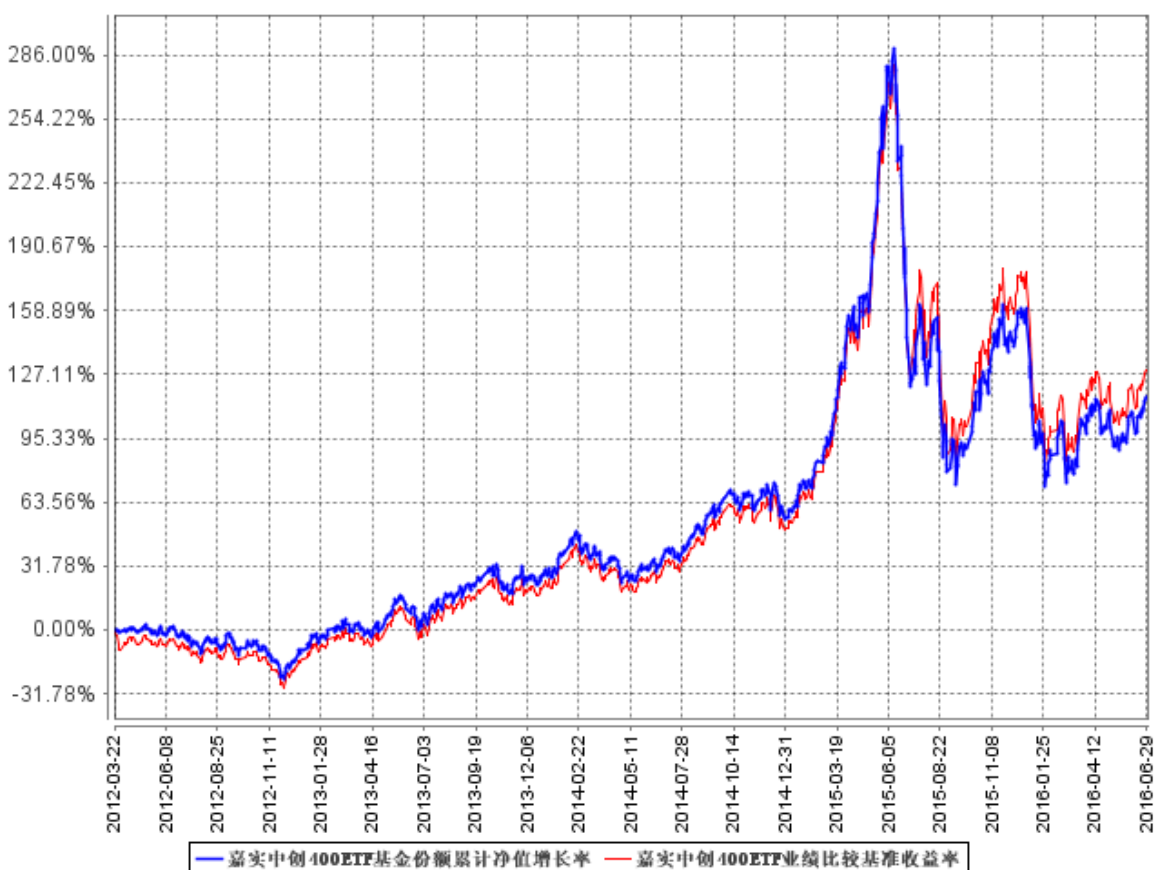
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.69%	1.71%	6.73%	1.71%	-0.04%	0.00%

过去三个月	4.65%	1.86%	4.79%	1.87%	-0.14%	-0.01%
过去六个月	-15.40%	2.76%	-15.67%	2.78%	0.27%	-0.02%
过去一年	-25.57%	2.89%	-20.06%	2.98%	-5.51%	-0.09%
过去三年	111.87%	2.20%	137.70%	2.24%	-25.83%	-0.04%
自基金合同生效起至今	115.64%	2.01%	129.70%	2.05%	-14.06%	-0.04%

### 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 2016 年 6 月 30 日)

注 1：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十三部分二、投资范围和六、投资限制（一）投资组合限制”的有关约定。

注 2：2016 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职务，聘请陈正宪先生、刘珈吟女士担任本基金基金经理职务。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。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 2016 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、93 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300 ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混

合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈正宪	本基金、嘉实沪深 300ETF 及其联接、嘉实中证 500ETF 及其联接、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）基金经理	2016 年 3 月 24 日	-	11 年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国台湾籍。
刘珈吟	本基金、嘉实中证金融地产 ETF 及其联接、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实深证基本面 120ETF 及其联接、嘉实中创 400ETF 联接基金经理	2016 年 3 月 24 日	-	7 年	2009 年加入嘉实基金管理有限公司，曾任指数投资部指数研究员一职。现任指数投资部基金经理。
何如	本基金、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 及其联接、嘉实沪深 300ETF 及其联接、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 及其联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）基金经理	2014 年 5 月 9 日	2016 年 3 月 24 日	10 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限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部副总监、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、离任日期指公司作出决定后公告之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《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 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.03%，年度化拟合偏离度为 0.50%。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 2.1564 元；本报告期基金份额净值增长率为-15.40%，业绩比较基准收益率为-15.67%。

## 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。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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”。收益评价日，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，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中创 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：中创 400 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	966,795.24	1,675,294.88
结算备付金		9,160.70	232,372.66
存出保证金		1,459.74	31,889.82
交易性金融资产	6.4.7.2	168,861,731.50	170,685,191.45
其中：股票投资		168,861,731.50	170,685,191.45
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	190.80	298.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		169,839,337.98	172,625,047.56
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		64,025.62	21,925.95
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		68,926.85	72,638.62
应付托管费		13,785.33	14,527.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	24,749.75	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	6.4.7.8	259,259.58	285,000.00
负债合计		430,747.13	410,110.08
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	78,561,264.00	67,561,264.00
未分配利润	6.4.7.10	90,847,326.85	104,653,673.48
所有者权益合计		169,408,590.85	172,214,937.48
负债和所有者权益总计		169,839,337.98	172,625,047.56

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.1564 元，基金份额总额 78,561,264.00 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
<b>一、收入</b>		-23,404,382.23	56,834,419.25
1.利息收入		6,993.66	9,360.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,977.13	9,360.63
债券利息收入		16.53	-
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		-852,137.76	33,209,687.28
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,441,810.88	32,741,994.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,971.80	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	579,701.32	467,692.73
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-22,552,251.82	23,581,491.78
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	-6,986.31	33,879.56
<b>减：二、费用</b>		840,101.96	944,763.55
1. 管理人报酬		385,403.67	397,739.20
2. 托管费		77,080.67	79,547.81
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	93,194.04	109,053.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	284,423.58	358,423.27
<b>三、利润总额</b>		-24,244,484.19	55,889,655.70
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		-24,244,484.19	55,889,655.70

### 6.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	67,561,264.00	104,653,673.48	172,214,937.48
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-24,244,484.19	-24,244,484.19
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数	11,000,000.00	10,438,137.56	21,438,137.56
其中：1. 基金申购款	21,000,000.00	20,724,733.36	41,724,733.36
2. 基金赎回款	-10,000,000.00	-10,286,595.80	-20,286,595.80
四、本期向基金份额持	-	-	-



### 6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人
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

### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

#### 6.4.4.2 关联方报酬

##### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	385,403.67	397,739.20
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。

##### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	77,080.67	79,547.81

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。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

##### 6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	74,684,808.00	95.07%	62,684,808.00	92.78%

#### 6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	966,795.24	6,128.34	1,163,798.58	7,357.66

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按适用利率计息。

#### 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

## 6.4.5 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

### 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
002052	同洲 电子	2016 年 1 月 12 日	重大 事项 停牌	10.03	-	-	37,568	490,140.55	376,807.04	-
002071	长城 影视	2016 年 6 月 15 日	重大 事项 停牌	13.64	-	-	21,800	393,596.09	297,352.00	-
002089	新海 宜	2016 年 1 月 8 日	重大 事项 停牌	16.88	2016 年 7 月 18 日	18.55	27,979	493,060.55	472,285.52	-
002249	大洋 电机	2016 年 6 月 8 日	重大 事项 停牌	11.97	2016 年 7 月 28 日	10.77	37,488	435,340.56	448,731.36	-
002280	联络 互动	2016 年 4 月 25 日	重大 事项 停牌	19.71	-	-	41,700	847,889.72	821,907.00	-
002283	天润 曲轴	2016 年 3 月 23 日	重大 事项 停牌	17.15	-	-	26,277	425,996.93	450,650.55	-
002297	博云 新材	2016 年 6 月 20 日	重大 事项 停牌	13.09	-	-	22,050	297,692.40	288,634.50	-
002313	日海 通讯	2016 年 6 月 20 日	重大 事项 停牌	13.59	2016 年 7 月 4 日	14.95	18,689	281,741.24	253,983.51	-

002314	南山控股	2016年3月7日	重大事项停牌	6.83	2016年7月19日	7.51	22,400	172,000.05	152,992.00	-
002331	皖通科技	2016年4月18日	重大事项停牌	16.54	2016年7月11日	15.31	20,160	383,182.82	333,446.40	-
002373	千方科技	2016年5月12日	重大事项停牌	14.94	2016年8月16日	16.43	30,200	581,651.45	451,188.00	-
002389	南洋科技	2016年2月3日	重大事项停牌	12.95	-	-	21,782	358,618.03	282,076.90	-
002432	九安医疗	2016年6月20日	重大事项停牌	18.14	2016年7月13日	19.95	16,288	379,748.95	295,464.32	-
002447	壹桥海参	2016年3月9日	重大事项停牌	7.19	-	-	37,776	388,010.27	271,609.44	-
002469	三维工程	2016年5月10日	重大事项停牌	9.01	2016年8月2日	8.11	27,377	296,003.02	246,666.77	-
002512	达华智能	2016年6月21日	重大事项停牌	20.28	2016年7月21日	19.38	25,050	309,931.36	508,014.00	-
002555	三七互娱	2016年3月10日	重大事项停牌	18.10	2016年8月16日	19.91	24,260	432,111.58	439,106.00	-
002574	明牌珠宝	2016年6月27日	重大事项停牌	13.04	-	-	19,600	288,824.55	255,584.00	-
002630	华西能源	2016年4月25日	重大事项停牌	11.06	-	-	44,760	526,885.31	495,045.60	-



002631	德尔未来	2016年6月29日	重大事项停牌	26.60	-	-	13,400	324,346.64	356,440.00	-
002663	普邦园林	2016年4月27日	重大事项停牌	7.36	-	-	67,454	531,702.94	496,461.44	-
002672	东江环保	2016年5月23日	重大事项停牌	17.33	2016年7月15日	19.06	29,275	539,276.17	507,335.75	-
300032	金龙机电	2016年6月28日	重大事项停牌	20.10	2016年7月7日	19.80	21,190	516,030.01	425,919.00	-
300052	中青宝	2016年6月8日	重大事项停牌	22.03	-	-	12,100	338,729.93	266,563.00	-
300080	易成新能	2016年5月19日	重大事项停牌	7.76	-	-	29,114	271,754.16	225,924.64	-
300110	华仁药业	2016年1月27日	重大事项停牌	9.53	2016年7月12日	10.48	22,900	292,985.00	218,237.00	-
300111	向日葵	2016年6月14日	重大事项停牌	4.90	-	-	73,739	460,257.69	361,321.10	-
300142	沃森生物	2016年3月22日	重大事项停牌	11.16	-	-	71,140	774,606.51	793,922.40	-
300166	东方国信	2016年6月8日	重大事项停牌	27.47	-	-	23,736	704,032.39	652,027.92	-
300284	苏交科	2016年5月20日	重大事项停牌	19.49	2016年8月10日	21.44	22,900	433,314.78	446,321.00	-

300300	汉鼎宇佑	2016年5月9日	重大事项停牌	30.56	-	-	14,800	445,458.44	452,288.00	-
300332	天壕环境	2016年4月11日	重大事项停牌	9.37	2016年7月29日	9.91	36,800	421,866.65	344,816.00	-
300355	蒙草生态	2016年6月30日	重大事项停牌	7.11	2016年7月6日	7.38	35,200	311,798.58	250,272.00	-
300413	快乐购	2016年6月20日	重大事项停牌	24.35	-	-	5,500	189,551.81	133,925.00	-

### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2016年6月30日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2016年6月30日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

## §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	168,861,731.50	99.42
	其中：股票	168,861,731.50	99.42
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	975,955.94	0.57

7	其他各项资产	1,650.54	0.00
	合计	169,839,337.98	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 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,028,696.83	1.79
B	采矿业	1,697,375.77	1.00
C	制造业	118,316,117.32	69.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,095,023.23	0.65
E	建筑业	3,944,158.45	2.33
F	批发和零售业	4,688,951.03	2.77
G	交通运输、仓储和邮政业	800,682.06	0.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,753,026.70	15.79
J	金融业	-	-
K	房地产业	828,679.93	0.49
L	租赁和商务服务业	1,744,271.96	1.03
M	科学研究和技术服务业	1,516,934.41	0.90
N	水利、环境和公共设施管理业	507,335.75	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,413,397.87	0.83
R	文化、体育和娱乐业	2,527,080.19	1.49
S	综合	-	-
	合计	168,861,731.50	99.68

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例 (%)
1	002407	多氟多	33,305	1,418,459.95	0.84
2	300408	三环集团	71,100	1,276,956.00	0.75
3	002074	国轩高科	25,289	998,156.83	0.59
4	002085	万丰奥威	54,944	944,487.36	0.56
5	300136	信维通信	44,400	930,624.00	0.55
6	300113	顺网科技	24,494	929,792.24	0.55
7	002572	索菲亚	16,300	913,126.00	0.54
8	002426	胜利精密	90,600	892,410.00	0.53
9	002070	众和股份	34,934	882,083.50	0.52
10	002508	老板电器	23,766	873,875.82	0.52

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站

(<http://www.jsfund.cn>) 的半年度报告正文。

### 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前五名股票投资明细

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300408	三环集团	802,244.00	0.47
2	300296	利亚德	512,436.13	0.30
3	300333	兆日科技	505,100.00	0.29
4	300078	思创医惠	498,006.00	0.29
5	002011	盾安环境	497,991.00	0.29
6	300136	信维通信	481,778.00	0.28
7	300266	兴源环境	478,875.85	0.28
8	002048	宁波华翔	470,391.00	0.27
9	002709	天赐材料	455,834.00	0.26
10	002343	慈文传媒	446,198.50	0.26
11	002092	中泰化学	434,225.00	0.25
12	002326	永太科技	419,880.00	0.24
13	002311	海大集团	414,974.00	0.24
14	002329	皇氏集团	413,991.00	0.24
15	002075	沙钢股份	385,205.00	0.22

16	002250	联化科技	383,383.14	0.22
17	002073	软控股份	378,689.00	0.22
18	002426	胜利精密	376,807.00	0.22
19	002501	利源精制	375,332.00	0.22
20	300199	翰宇药业	368,195.00	0.21

#### 7.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002466	天齐锂业	1,456,969.20	0.85
2	002460	赣锋锂业	910,405.00	0.53
3	002176	江特电机	811,419.28	0.47
4	002681	奋达科技	671,705.00	0.39
5	002273	水晶光电	665,846.00	0.39
6	002439	启明星辰	560,988.88	0.33
7	300028	金亚科技	547,648.50	0.32
8	002276	万马股份	527,997.22	0.31
9	300208	恒顺众昇	506,391.00	0.29
10	300244	迪安诊断	492,544.00	0.29
11	002489	浙江永强	483,598.00	0.28
12	002179	中航光电	438,856.61	0.25
13	300185	通裕重工	370,784.00	0.22
14	002470	金正大	370,599.54	0.22
15	002424	贵州百灵	365,448.60	0.21
16	002018	华信国际	355,176.00	0.21
17	002657	中科金财	339,779.00	0.20
18	002306	中科云网	311,094.36	0.18
19	002342	巨力索具	278,860.00	0.16
20	002563	森马服饰	268,767.00	0.16

#### 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	38,078,243.64
卖出股票收入（成交）总额	35,314,785.89

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

## 7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

## 7.11 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

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。

### 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	1,459.74
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	190.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	1,650.54

#### 7.12.4 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。

#### 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

报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 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

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

## §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 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
411	191,146.63	74,684,808.00	95.07%	3,876,456.00	4.93%

#### 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 400ETF 联接	74,684,808.00	95.07%

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。

### 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	李平曾	148,700.00	0.19%

2	马学清	145,026.00	0.18%
3	薛芸	140,000.00	0.18%
4	张凡	140,000.00	0.18%
5	王传宁	121,010.00	0.15%
6	何凤珍	107,099.00	0.14%
7	徐隽婵	103,270.00	0.13%
8	谭惠玲	100,009.00	0.13%
9	许爱贞	80,000.00	0.10%
10	徐立群	66,500.00	0.08%
	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	74,684,808.00	95.07%

### 8.3 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%

### 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、基金投资和相关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	67,561,264.00
本报告期基金总申购份额	21,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	10,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	78,561,264.00



## §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

2016 年 1 月 20 日本基金管理人发布公告，戴京焦女士因工作变动不再担任公司副总经理。

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。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券股份	2	47,012,754.23	64.08%	32,913.49	64.08%	新增 1 个

有限公司						
东方证券股份有限公司	1	26,355,905.90	35.92%	18,449.79	35.92%	新增
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券	1	-	-	-	-	-

有限责任公司						
中银国际证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份 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：齐鲁证券有限公司更名为中泰证券股份有限公司。

注 4：长城证券有限责任公司更名为长城证券股份有限公司。

注 5：中国国际金融有限公司更名为中国国际金融股份有限公司。

### 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	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
长江证券股份有限公司	60,288.33	100.00%

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

嘉实基金管理有限公司  
2016 年 8 月 27 日