

# 中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
7.8 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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	53
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>56</b>
11.1 备查文件目录.....	56
11.2 存放地点.....	56
11.3 查阅方式.....	56

## § 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
注册地址		中国（上海）自由贸易试验	北京市西城区复兴门内大街 55

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

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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(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。

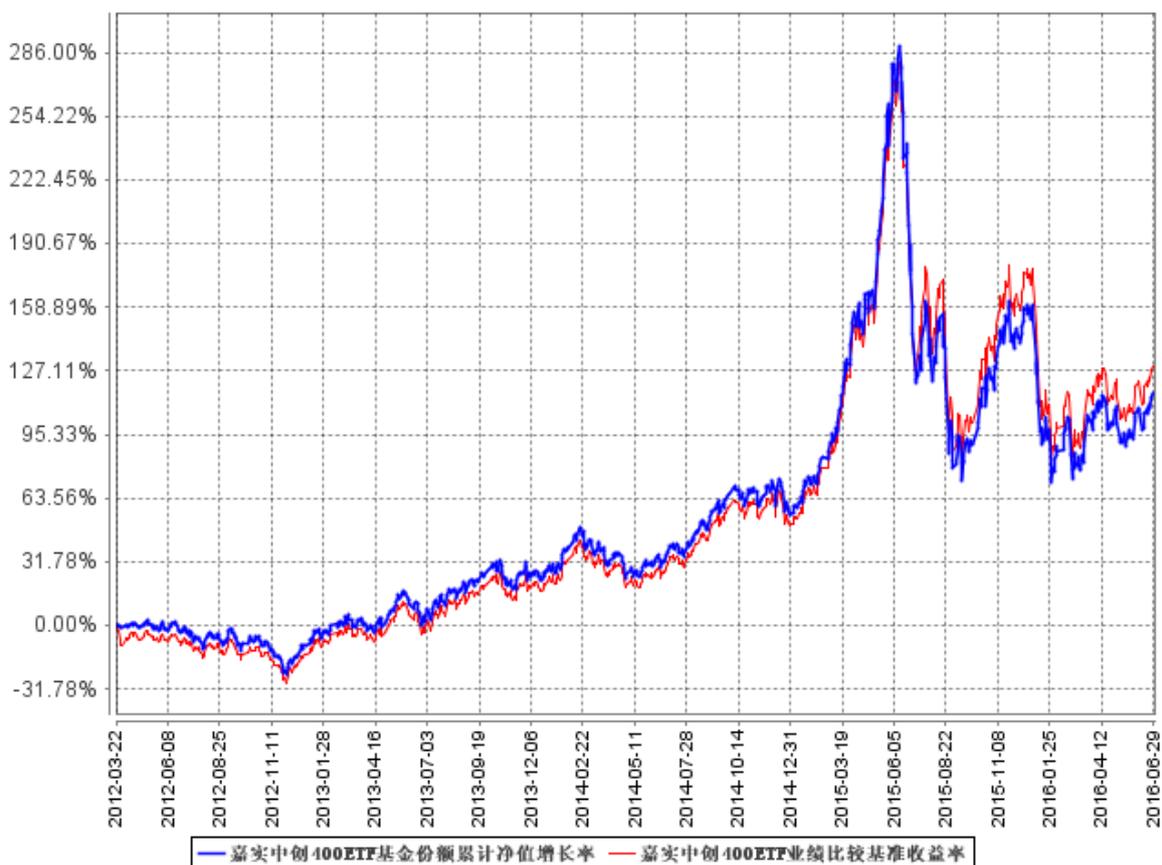
## 3.2 基金净值表现

### 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	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

	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				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	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-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	-	-24,244,484.19	-24,244,484.19

基金净值变动数（本期利润）			
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）	78,561,264.00	90,847,326.85	169,408,590.85
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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）	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）	-	55,889,655.70	55,889,655.70
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,000,000.00	50,228,070.22	52,228,070.22
其中：1. 基金申购款	61,000,000.00	117,270,404.92	178,270,404.92
2. 基金赎回款	-59,000,000.00	-67,042,334.70	-126,042,334.70
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）	78,561,264.00	149,040,373.81	227,601,637.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

          赵学军                                        王红                                        常旭            
 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，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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操

作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免征增值税：a) 同业存款；b) 买入返售金融资产(质押式、买断式)；c) 国债、地方政府债；d) 金融债券。

(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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	966,795.24
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	966,795.24

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	172,283,524.31	168,861,731.50	-3,421,792.81
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	172,283,524.31	168,861,731.50	-3,421,792.81

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2016年6月30日），本基金未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2016年6月30日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	183.85
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	6.32
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	0.63
合计	190.80

#### 6.4.7.6 其他资产

本期末（2016年6月30日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	24,749.75
银行间市场应付交易费用	-
合计	24,749.75

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

预提费用	184,259.58
应付指数使用费	75,000.00
其他	-
合计	259,259.58

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,561,264.00	67,561,264.00
本期申购	21,000,000.00	21,000,000.00
本期赎回	-10,000,000.00	-10,000,000.00
本期末	78,561,264.00	78,561,264.00

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	56,925,255.68	47,728,417.80	104,653,673.48
本期利润	-1,692,232.37	-22,552,251.82	-24,244,484.19
本期基金份额交易产生的变动数	9,293,077.21	1,145,060.35	10,438,137.56
其中：基金申购款	17,581,243.83	3,143,489.53	20,724,733.36
基金赎回款	-8,288,166.62	-1,998,429.18	-10,286,595.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,526,100.52	26,321,226.33	90,847,326.85

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	6,128.34
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	796.42
其他	52.37
合计	6,977.13

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	278,379.73
股票投资收益——赎回差价收入	-1,720,190.61
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,441,810.88

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	35,314,785.89
减：卖出股票成本总额	35,036,406.16
买卖股票差价收入	278,379.73

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
赎回基金份额对价总额	20,286,595.80
减：现金支付赎回款总额	1,529,097.80
减：赎回股票成本总额	20,477,688.61
赎回差价收入	-1,720,190.61

### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	60,288.33
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	50,300.00
减：应收利息总额	16.53
买卖债券差价收入	9,971.80

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	579,701.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	579,701.32

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-22,552,251.82
——股票投资	-22,552,251.82
——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	-22,552,251.82

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
基金转出费收入	-
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
替代损益	-6,986.31
其他	-
合计	-6,986.31

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	93,194.04
银行间市场交易费用	-
合计	93,194.04

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	74,589.06
债券托管账户维护费	-
银行划款手续费	164.00
指数使用费	150,000.00
上市年费	29,835.26
红利手续费	-
其他	-
合计	284,423.58

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人
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	本基金的联接基金

基金联接基金(“嘉实中创 400ETF 联接”)	
--------------------------	--

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(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。

##### 6.4.10.2 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 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。

###### 6.4.10.2.2 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。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期(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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内(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。

##### 6.4.10.4.2 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 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%

##### 6.4.10.5 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 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。

##### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本期(2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日)，本基金未实施利润分配。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末(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。

## 6.4.12.2 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
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	18.14	2016年7月13日	19.95	16,288	379,748.95	295,464.32	-

		日	停牌		日					
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	2016年	重大	11.16	-	-	71,140	774,606.51	793,922.40	-

	生物	3月22日	事项停牌							
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	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2016年6月30日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2016年6月30日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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。

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有债券投资（上年度末：无）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	966,795.24	-	-	-	966,795.24
结算备付金	9,160.70	-	-	-	9,160.70
存出保证金	1,459.74	-	-	-	1,459.74
交易性金融资产	-	-	-	168,861,731.50	168,861,731.50
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	-	-	-	190.80	190.80
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	977,415.68	-	-	168,861,922.30	169,839,337.98
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	-	-	-	64,025.62	64,025.62
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	68,926.85	68,926.85
应付托管费	-	-	-	13,785.33	13,785.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	24,749.75	24,749.75
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	259,259.58	259,259.58
负债总计	-	-	-	430,747.13	430,747.13
利率敏感度缺口	977,415.68	-	-	168,431,175.17	169,408,590.85
上年度末 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

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：无），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采取完全复制法，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。

##### 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 2016年6月30日		上年度末 2015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	168,861,731.50	99.68	170,685,191.45	99.11
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	168,861,731.50	99.68	170,685,191.45	99.11

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2016年6月30日)	上年度末 (2015年12月31日)
	业绩比较基准上升 5%	8,216,316.66	8,357,982.70
	业绩比较基准下降 5%	-8,216,316.66	-8,357,982.70

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一

层次的余额为 155,788,412.34 元,属于第二层次的余额为 13,073,319.16 元,无属于第三层次的余额(上年度末:第一层次 155,441,176.43 元,第二层次 15,244,015.02 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,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。

## § 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	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
11	300088	长信科技	58,700	872,869.00	0.52
12	300015	爱尔眼科	23,275	850,235.75	0.50
13	002280	联络互动	41,700	821,907.00	0.49
14	300142	沃森生物	71,140	793,922.40	0.47
15	002299	圣农发展	29,500	764,050.00	0.45
16	300156	神雾环保	36,495	751,067.10	0.44
17	002108	沧州明珠	28,490	737,891.00	0.44
18	002311	海大集团	44,900	708,073.00	0.42
19	002168	深圳惠程	48,973	689,539.84	0.41
20	300101	振芯科技	24,648	688,418.64	0.41
21	002221	东华能源	56,276	686,004.44	0.40
22	002224	三力士	29,500	682,925.00	0.40
23	300014	亿纬锂能	15,802	682,488.38	0.40
24	300367	东方网力	27,400	680,342.00	0.40
25	300324	旋极信息	31,000	665,260.00	0.39
26	002491	通鼎互联	38,900	663,634.00	0.39
27	002131	利欧股份	38,774	662,647.66	0.39
28	002444	巨星科技	32,200	654,304.00	0.39
29	002544	杰赛科技	20,384	653,714.88	0.39
30	300068	南都电源	29,875	653,067.50	0.39
31	300166	东方国信	23,736	652,027.92	0.38
32	300267	尔康制药	45,200	647,264.00	0.38
33	300159	新研股份	35,800	646,190.00	0.38

34	300274	阳光电源	26,000	634,400.00	0.37
35	300115	长盈精密	30,560	629,536.00	0.37
36	300009	安科生物	21,047	628,884.36	0.37
37	002155	湖南黄金	47,700	628,209.00	0.37
38	002023	海特高新	36,180	626,999.40	0.37
39	002048	宁波华翔	27,300	624,351.00	0.37
40	002138	顺络电子	34,394	623,563.22	0.37
41	002018	华信国际	65,188	619,286.00	0.37
42	300078	思创医惠	18,400	615,296.00	0.36
43	002268	卫士通	17,182	614,084.68	0.36
44	002075	沙钢股份	42,800	612,896.00	0.36
45	300001	特锐德	28,074	608,925.06	0.36
46	002610	爱康科技	32,000	605,440.00	0.36
47	002308	威创股份	36,843	605,330.49	0.36
48	300271	华宇软件	31,967	604,815.64	0.36
49	002271	东方雨虹	34,842	600,327.66	0.35
50	300010	立思辰	28,579	599,587.42	0.35
51	002326	永太科技	29,200	595,680.00	0.35
52	300199	翰宇药业	28,700	584,045.00	0.34
53	002467	二六三	37,856	583,360.96	0.34
54	300182	捷成股份	33,750	577,462.50	0.34
55	300207	欣旺达	22,488	577,266.96	0.34
56	300287	飞利信	43,000	576,200.00	0.34
57	002477	雏鹰农牧	96,087	573,639.39	0.34
58	002123	荣信股份	27,473	571,163.67	0.34
59	002714	牧原股份	11,300	570,989.00	0.34
60	002185	华天科技	44,548	567,096.04	0.33
61	300238	冠昊生物	12,900	566,052.00	0.33
62	002368	太极股份	15,908	565,211.24	0.33
63	300347	泰格医药	19,406	563,162.12	0.33
64	300216	千山药机	17,600	556,688.00	0.33
65	300020	银江股份	29,821	554,670.60	0.33
66	002474	榕基软件	29,288	553,543.20	0.33
67	002161	远望谷	37,000	550,930.00	0.33
68	002303	美盈森	44,800	550,592.00	0.33
69	002067	景兴纸业	66,931	549,503.51	0.32
70	002428	云南锗业	31,900	548,042.00	0.32
71	002245	澳洋顺昌	42,678	544,998.06	0.32
72	300053	欧比特	29,828	541,378.20	0.32

73	002466	天齐锂业	12,654	540,199.26	0.32
74	002284	亚太股份	28,200	538,338.00	0.32
75	002055	得润电子	17,572	538,054.64	0.32
76	300203	聚光科技	20,300	535,920.00	0.32
77	300026	红日药业	30,800	535,612.00	0.32
78	002665	首航节能	67,350	531,391.50	0.31
79	002583	海能达	43,790	527,231.60	0.31
80	300291	华录百纳	22,347	525,824.91	0.31
81	300118	东方日升	27,848	525,213.28	0.31
82	300377	赢时胜	10,600	524,594.00	0.31
83	002371	七星电子	12,368	517,229.76	0.31
84	300043	互动娱乐	36,340	514,937.80	0.30
85	002050	三花股份	53,244	513,804.60	0.30
86	002121	科陆电子	43,673	513,157.75	0.30
87	002522	浙江众成	27,200	510,000.00	0.30
88	002512	达华智能	25,050	508,014.00	0.30
89	002013	中航机电	37,665	507,724.20	0.30
90	002436	兴森科技	22,276	507,670.04	0.30
91	002672	东江环保	29,275	507,335.75	0.30
92	300296	利亚德	16,000	506,560.00	0.30
93	002002	鸿达兴业	26,800	503,840.00	0.30
94	002099	海翔药业	52,472	499,533.44	0.29
95	002325	洪涛股份	54,071	496,912.49	0.29
96	002663	普邦园林	67,454	496,461.44	0.29
97	002047	宝鹰股份	49,600	496,000.00	0.29
98	300054	鼎龙股份	19,805	495,521.10	0.29
99	002630	华西能源	44,760	495,045.60	0.29
100	002462	嘉事堂	13,200	491,700.00	0.29
101	300266	兴源环境	11,700	489,528.00	0.29
102	300012	华测检测	39,000	482,820.00	0.29
103	002174	游族网络	14,988	479,616.00	0.28
104	002019	亿帆鑫富	30,950	476,011.00	0.28
105	002056	横店东磁	28,000	476,000.00	0.28
106	300147	香雪制药	32,166	473,805.18	0.28
107	002031	巨轮智能	104,610	472,837.20	0.28
108	002089	新海宜	27,979	472,285.52	0.28
109	002364	中恒电气	17,200	471,796.00	0.28
110	002448	中原内配	30,900	471,225.00	0.28
111	002281	光迅科技	7,304	468,916.80	0.28

112	002097	山河智能	45,491	468,102.39	0.28
113	002431	棕榈股份	40,653	467,509.50	0.28
114	002437	誉衡药业	53,700	467,190.00	0.28
115	300359	全通教育	15,700	465,662.00	0.27
116	002550	千红制药	55,452	462,469.68	0.27
117	002390	信邦制药	49,900	461,076.00	0.27
118	002384	东山精密	23,200	460,752.00	0.27
119	002642	荣之联	17,491	460,188.21	0.27
120	002256	彩虹精化	13,968	458,150.40	0.27
121	002640	跨境通	25,900	456,358.00	0.27
122	002440	闰土股份	30,692	455,776.20	0.27
123	002622	永大集团	36,900	453,870.00	0.27
124	002366	台海核电	8,500	453,135.00	0.27
125	300300	汉鼎宇佑	14,800	452,288.00	0.27
126	002595	豪迈科技	21,140	451,761.80	0.27
127	300096	易联众	24,629	451,695.86	0.27
128	002373	千方科技	30,200	451,188.00	0.27
129	002283	天润曲轴	26,277	450,650.55	0.27
130	002488	金固股份	21,400	449,828.00	0.27
131	002261	拓维信息	32,500	449,475.00	0.27
132	002249	大洋电机	37,488	448,731.36	0.26
133	002709	天赐材料	6,400	447,616.00	0.26
134	002237	恒邦股份	34,700	446,936.00	0.26
135	300284	苏交科	22,900	446,321.00	0.26
136	300075	数字政通	17,400	446,310.00	0.26
137	002343	慈文传媒	9,200	446,200.00	0.26
138	002285	世联行	57,267	446,109.93	0.26
139	002106	莱宝高科	37,500	445,500.00	0.26
140	002025	航天电器	18,004	444,518.76	0.26
141	002092	中泰化学	52,500	444,150.00	0.26
142	300297	蓝盾股份	27,852	443,682.36	0.26
143	002177	御银股份	44,902	442,284.70	0.26
144	002638	勤上光电	20,600	442,282.00	0.26
145	002091	江苏国泰	27,750	439,837.50	0.26
146	002555	三七互娱	24,260	439,106.00	0.26
147	002253	川大智胜	11,740	438,489.00	0.26
148	002396	星网锐捷	22,193	437,202.10	0.26
149	002421	达实智能	24,960	436,051.20	0.26
150	002217	合力泰	28,400	434,520.00	0.26

151	002443	金洲管道	30,232	433,829.20	0.26
152	300122	智飞生物	28,000	433,160.00	0.26
153	002130	沃尔核材	26,580	427,406.40	0.25
154	002095	生意宝	7,620	426,643.80	0.25
155	300032	金龙机电	21,190	425,919.00	0.25
156	002588	史丹利	34,460	425,581.00	0.25
157	300065	海兰信	11,000	425,480.00	0.25
158	002210	飞马国际	20,844	423,966.96	0.25
159	002603	以岭药业	26,600	423,206.00	0.25
160	300011	鼎汉技术	18,000	422,460.00	0.25
161	300252	金信诺	12,700	420,751.00	0.25
162	002367	康力电梯	27,234	419,403.60	0.25
163	002318	久立特材	36,128	418,000.96	0.25
164	002625	龙生股份	9,500	417,810.00	0.25
165	002463	沪电股份	78,954	416,877.12	0.25
166	300212	易华录	13,997	416,690.69	0.25
167	300131	英唐智控	35,200	415,712.00	0.25
168	002664	信质电机	12,200	415,044.00	0.24
169	300364	中文在线	7,965	414,180.00	0.24
170	002011	盾安环境	36,700	413,976.00	0.24
171	002041	登海种业	26,600	413,364.00	0.24
172	002254	泰和新材	30,040	412,148.80	0.24
173	002117	东港股份	12,856	404,449.76	0.24
174	002547	春兴精工	36,500	403,690.00	0.24
175	002376	新北洋	30,197	403,431.92	0.24
176	002354	天神娱乐	4,600	401,488.00	0.24
177	002505	大康农业	102,450	399,555.00	0.24
178	002690	美亚光电	17,300	398,592.00	0.24
179	300183	东软载波	15,014	397,871.00	0.23
180	002094	青岛金王	14,879	397,418.09	0.23
181	002329	皇氏集团	26,500	397,235.00	0.23
182	002563	森马服饰	36,600	396,378.00	0.23
183	002497	雅化集团	51,278	395,353.38	0.23
184	002479	富春环保	35,201	395,307.23	0.23
185	300333	兆日科技	16,600	395,080.00	0.23
186	300202	聚龙股份	16,300	394,623.00	0.23
187	300257	开山股份	23,700	391,524.00	0.23
188	300336	新文化	15,667	391,361.66	0.23
189	002681	奋达科技	23,100	389,928.00	0.23

190	002480	新筑股份	35,788	389,015.56	0.23
191	002429	兆驰股份	46,400	388,832.00	0.23
192	300226	上海钢联	7,696	387,878.40	0.23
193	002028	思源电气	35,360	387,192.00	0.23
194	002501	利源精制	35,800	386,640.00	0.23
195	002317	众生药业	32,200	386,078.00	0.23
196	002250	联化科技	26,800	383,776.00	0.23
197	002339	积成电子	21,008	383,185.92	0.23
198	300228	富瑞特装	22,540	383,180.00	0.23
199	300045	华力创通	20,000	383,000.00	0.23
200	002309	中利科技	21,384	382,987.44	0.23
201	002244	滨江集团	57,100	382,570.00	0.23
202	300004	南风股份	19,404	380,318.40	0.22
203	002151	北斗星通	11,277	379,583.82	0.22
204	002073	软控股份	31,500	379,575.00	0.22
205	002298	中电鑫龙	23,000	379,500.00	0.22
206	300157	恒泰艾普	35,050	378,189.50	0.22
207	300005	探路者	22,144	377,555.20	0.22
208	300034	钢研高纳	17,076	377,379.60	0.22
209	002180	艾派克	13,225	377,309.25	0.22
210	002414	高德红外	13,986	377,202.42	0.22
211	002263	大东南	85,506	377,081.46	0.22
212	002052	同洲电子	37,568	376,807.04	0.22
213	002635	安洁科技	9,800	376,124.00	0.22
214	002296	辉煌科技	20,720	376,068.00	0.22
215	002551	尚荣医疗	16,012	374,360.56	0.22
216	002197	证通电子	19,472	374,251.84	0.22
217	002079	苏州固锔	33,407	373,156.19	0.22
218	002341	新纶科技	17,312	372,727.36	0.22
219	002064	华峰氨纶	77,300	371,040.00	0.22
220	002242	九阳股份	20,300	369,054.00	0.22
221	300178	腾邦国际	19,180	368,256.00	0.22
222	002156	通富微电	26,044	367,220.40	0.22
223	300191	潜能恒信	7,999	365,794.27	0.22
224	300039	上海凯宝	35,844	364,533.48	0.22
225	002650	加加食品	51,050	362,965.50	0.21
226	300111	向日葵	73,739	361,321.10	0.21
227	002288	超华科技	36,484	361,191.60	0.21
228	002020	京新药业	29,192	361,105.04	0.21

229	300352	北信源	19,340	361,077.80	0.21
230	002262	恩华药业	17,846	359,596.90	0.21
231	002433	太安堂	35,673	357,443.46	0.21
232	002577	雷柏科技	7,000	357,350.00	0.21
233	002631	德尔未来	13,400	356,440.00	0.21
234	002267	陕天然气	33,800	354,900.00	0.21
235	300339	润和软件	9,900	354,816.00	0.21
236	002157	正邦科技	15,119	354,691.74	0.21
237	300134	大富科技	11,800	353,528.00	0.21
238	002358	森源电气	22,812	351,989.16	0.21
239	002126	银轮股份	39,634	349,571.88	0.21
240	300090	盛运环保	43,080	348,517.20	0.21
241	300197	铁汉生态	24,981	346,236.66	0.20
242	002600	江粉磁材	28,600	345,488.00	0.20
243	002269	美邦服饰	78,500	345,400.00	0.20
244	300496	中科创达	5,100	345,372.00	0.20
245	002093	国脉科技	27,800	344,998.00	0.20
246	300332	天壕环境	36,800	344,816.00	0.20
247	002649	博彦科技	8,700	344,259.00	0.20
248	002215	诺普信	33,265	343,960.10	0.20
249	300098	高新兴	21,600	343,008.00	0.20
250	300231	银信科技	18,600	342,984.00	0.20
251	300047	天源迪科	17,100	341,145.00	0.20
252	002178	延华智能	31,068	341,126.64	0.20
253	002029	七匹狼	33,500	340,025.00	0.20
254	300463	迈克生物	12,500	338,375.00	0.20
255	002570	贝因美	26,400	337,656.00	0.20
256	002498	汉缆股份	77,800	337,652.00	0.20
257	300171	东富龙	17,756	335,233.28	0.20
258	002331	皖通科技	20,160	333,446.40	0.20
259	002154	报喜鸟	68,860	332,593.80	0.20
260	002527	新时达	21,050	332,590.00	0.20
261	300369	绿盟科技	7,850	332,133.50	0.20
262	002334	英威腾	37,132	330,474.80	0.20
263	300224	正海磁材	14,502	328,760.34	0.19
264	300302	同有科技	10,100	327,947.00	0.19
265	002449	国星光电	24,600	326,442.00	0.19
266	002517	恺英网络	7,400	326,192.00	0.19
267	300316	晶盛机电	24,900	326,190.00	0.19

268	002128	露天煤业	43,300	325,183.00	0.19
269	002556	辉隆股份	21,496	324,804.56	0.19
270	002503	搜于特	26,127	324,497.34	0.19
271	002411	必康股份	18,179	324,495.15	0.19
272	300386	飞天诚信	9,780	324,402.60	0.19
273	002078	太阳纸业	66,404	324,051.52	0.19
274	002229	鸿博股份	12,800	321,024.00	0.19
275	002369	卓翼科技	28,382	319,297.50	0.19
276	002277	友阿股份	27,700	319,104.00	0.19
277	300049	福瑞股份	13,400	318,518.00	0.19
278	300222	科大智能	11,600	317,724.00	0.19
279	002170	芭田股份	37,484	316,364.96	0.19
280	002581	未名医药	11,600	316,100.00	0.19
281	002009	天奇股份	19,200	313,536.00	0.19
282	300269	联建光电	12,000	311,760.00	0.18
283	002240	威华股份	23,276	310,967.36	0.18
284	300137	先河环保	21,000	310,590.00	0.18
285	002668	奥马电器	5,100	310,437.00	0.18
286	002413	雷科防务	22,400	307,552.00	0.18
287	002482	广田集团	40,263	305,193.54	0.18
288	002589	瑞康医药	9,900	304,029.00	0.18
289	002496	辉丰股份	51,887	303,538.95	0.18
290	002476	宝莫股份	37,500	303,375.00	0.18
291	002332	仙琚制药	26,912	301,414.40	0.18
292	002111	威海广泰	11,454	301,125.66	0.18
293	002737	葵花药业	8,000	299,760.00	0.18
294	002005	德豪润达	50,700	299,637.00	0.18
295	002214	大立科技	24,200	298,386.00	0.18
296	002408	齐翔腾达	54,271	297,947.79	0.18
297	002071	长城影视	21,800	297,352.00	0.18
298	002540	亚太科技	34,100	297,352.00	0.18
299	002148	北纬通信	14,896	297,175.20	0.18
300	002432	九安医疗	16,288	295,464.32	0.17
301	002416	爱施德	14,800	293,928.00	0.17
302	300229	拓尔思	13,734	293,632.92	0.17
303	300074	华平股份	24,379	292,548.00	0.17
304	002176	江特电机	18,992	292,476.80	0.17
305	300152	科融环境	38,700	291,798.00	0.17
306	002604	龙力生物	26,943	290,714.97	0.17

307	300288	朗玛信息	7,994	289,862.44	0.17
308	300392	腾信股份	10,700	289,756.00	0.17
309	002037	久联发展	17,883	289,346.94	0.17
310	002297	博云新材	22,050	288,634.50	0.17
311	300348	长亮科技	7,800	288,288.00	0.17
312	002279	久其软件	12,950	287,231.00	0.17
313	300056	三维丝	15,880	286,634.00	0.17
314	002658	雪迪龙	16,449	286,048.11	0.17
315	002032	苏泊尔	8,292	285,659.40	0.17
316	002345	潮宏基	29,194	285,517.32	0.17
317	002698	博实股份	14,716	283,430.16	0.17
318	002460	赣锋锂业	8,440	282,318.00	0.17
319	002389	南洋科技	21,782	282,076.90	0.17
320	300064	豫金刚石	27,706	282,047.08	0.17
321	002418	康盛股份	26,700	281,952.00	0.17
322	002481	双塔食品	38,585	281,670.50	0.17
323	002118	紫鑫药业	19,101	280,784.70	0.17
324	300295	三六五网	8,612	279,890.00	0.17
325	002260	德奥通航	10,700	277,665.00	0.16
326	300006	莱美药业	32,056	277,604.96	0.16
327	002251	步步高	21,309	276,377.73	0.16
328	002145	中核钛白	43,900	274,375.00	0.16
329	300031	宝通科技	10,700	273,064.00	0.16
330	002362	汉王科技	9,900	272,151.00	0.16
331	002447	壹桥海参	37,776	271,609.44	0.16
332	002609	捷顺科技	15,400	270,886.00	0.16
333	002226	江南化工	28,222	270,366.76	0.16
334	002293	罗莱生活	19,550	267,835.00	0.16
335	300052	中青宝	12,100	266,563.00	0.16
336	002564	天沃科技	34,600	266,420.00	0.16
337	002471	中超控股	43,000	264,450.00	0.16
338	002542	中化岩土	34,750	263,405.00	0.16
339	300245	天玑科技	11,850	263,070.00	0.16
340	002721	金一文化	13,500	260,955.00	0.15
341	002655	共达电声	16,137	260,612.55	0.15
342	300177	中海达	17,180	260,448.80	0.15
343	002571	德力股份	16,000	257,600.00	0.15
344	002711	欧浦智网	17,160	255,684.00	0.15
345	002574	明牌珠宝	19,600	255,584.00	0.15

346	300379	东方通	3,200	254,336.00	0.15
347	002313	日海通讯	18,689	253,983.51	0.15
348	002727	一心堂	10,100	252,500.00	0.15
349	002235	安妮股份	13,850	252,208.50	0.15
350	300083	劲胜精密	30,400	251,104.00	0.15
351	002043	兔宝宝	25,000	250,750.00	0.15
352	300355	蒙草生态	35,200	250,272.00	0.15
353	002751	易尚展示	3,900	249,639.00	0.15
354	300128	锦富新材	13,791	249,203.37	0.15
355	002468	艾迪西	8,700	248,994.00	0.15
356	002115	三维通信	21,650	248,758.50	0.15
357	300205	天喻信息	16,788	248,294.52	0.15
358	300368	汇金股份	8,400	247,464.00	0.15
359	002469	三维工程	27,377	246,666.77	0.15
360	300071	华谊嘉信	22,800	246,240.00	0.15
361	002697	红旗连锁	40,470	244,438.80	0.14
362	002181	粤传媒	29,500	242,195.00	0.14
363	300276	三丰智能	11,500	242,190.00	0.14
364	300263	隆华节能	21,600	241,488.00	0.14
365	002699	美盛文化	7,200	240,408.00	0.14
366	002773	康弘药业	5,150	239,732.50	0.14
367	300016	北陆药业	10,400	237,640.00	0.14
368	300439	美康生物	6,600	237,468.00	0.14
369	002273	水晶光电	8,450	236,515.50	0.14
370	002344	海宁皮城	24,000	234,000.00	0.14
371	300248	新开普	8,600	231,426.00	0.14
372	002143	印纪传媒	9,800	229,614.00	0.14
373	300188	美亚柏科	8,600	229,104.00	0.14
374	002502	骅威文化	9,200	226,320.00	0.13
375	300080	易成新能	29,114	225,924.64	0.13
376	002203	海亮股份	28,900	224,553.00	0.13
377	002378	章源钨业	21,000	219,450.00	0.13
378	300110	华仁药业	22,900	218,237.00	0.13
379	002036	联创电子	9,200	215,372.00	0.13
380	002493	荣盛石化	17,500	212,100.00	0.13
381	300148	天舟文化	13,922	211,753.62	0.12
382	002315	焦点科技	3,097	208,923.62	0.12
383	300307	慈星股份	15,694	206,846.92	0.12
384	002568	百润股份	9,400	206,800.00	0.12

385	002232	启明信息	13,220	202,530.40	0.12
386	300155	安居宝	13,600	199,648.00	0.12
387	002717	岭南园林	6,500	194,090.00	0.11
388	002233	塔牌集团	23,777	190,929.31	0.11
389	002227	奥特迅	5,440	177,779.20	0.10
390	300314	戴维医疗	7,300	176,879.00	0.10
391	002636	金安国纪	10,500	172,200.00	0.10
392	300093	金刚玻璃	7,100	168,199.00	0.10
393	002504	弘高创意	6,800	164,560.00	0.10
394	300376	易事特	5,800	158,282.00	0.09
395	002678	珠江钢琴	12,500	153,375.00	0.09
396	002314	南山控股	22,400	152,992.00	0.09
397	002602	世纪华通	8,100	150,093.00	0.09
398	002489	浙江永强	18,949	150,076.08	0.09
399	300485	赛升药业	3,200	148,672.00	0.09
400	002741	光华科技	5,800	147,726.00	0.09
401	002189	利达光电	5,200	146,952.00	0.09
402	002702	海欣食品	7,200	146,088.00	0.09
403	300413	快乐购	5,500	133,925.00	0.08
404	300185	通裕重工	14,724	131,338.08	0.08
405	002653	海思科	7,700	123,354.00	0.07
406	002216	三全食品	14,184	121,982.40	0.07
407	002752	昇兴股份	6,950	117,038.00	0.07
408	300329	海伦钢琴	5,700	113,943.00	0.07
409	002521	齐峰新材	8,400	96,096.00	0.06
410	002646	青青稞酒	4,200	86,562.00	0.05
411	002526	山东矿机	8,464	82,354.72	0.05
412	002083	孚日股份	12,694	79,972.20	0.05
413	002275	桂林三金	4,200	77,532.00	0.05
414	002454	松芝股份	4,228	76,865.04	0.05
415	002100	天康生物	8,440	75,875.60	0.04
416	002021	中捷资源	8,420	73,843.40	0.04
417	002628	成都路桥	10,524	73,352.28	0.04
418	002255	海陆重工	8,492	73,116.12	0.04
419	002342	巨力索具	12,600	73,080.00	0.04
420	300150	世纪瑞尔	6,392	69,225.36	0.04
421	300135	宝利国际	12,686	67,235.80	0.04
422	002107	沃华医药	4,200	67,200.00	0.04
423	002337	赛象科技	8,400	65,520.00	0.04

424	002122	天马股份	10,500	65,310.00	0.04
425	002259	升达林业	8,426	65,132.98	0.04
426	300262	巴安水务	4,240	64,956.80	0.04
427	002140	东华科技	4,200	64,092.00	0.04
428	002565	上海绿新	8,472	62,777.52	0.04
429	300139	晓程科技	4,200	61,782.00	0.04
430	002017	东信和平	4,290	61,776.00	0.04
431	300303	聚飞光电	6,320	60,103.20	0.04
432	002538	司尔特	6,300	58,905.00	0.03
433	300129	泰胜风能	8,400	58,800.00	0.03
434	002060	粤水电	8,492	58,340.04	0.03
435	300181	佐力药业	6,312	58,322.88	0.03
436	002363	隆基机械	4,220	54,944.40	0.03
437	002194	武汉凡谷	4,274	54,621.72	0.03
438	300363	博腾股份	2,175	53,983.50	0.03
439	002327	富安娜	6,334	53,902.34	0.03
440	300105	龙源技术	6,332	53,252.12	0.03
441	002392	北京利尔	10,588	52,304.72	0.03
442	002204	大连重工	12,664	51,162.56	0.03
443	002419	天虹商场	4,200	50,232.00	0.03
444	002307	北新路桥	6,342	49,784.70	0.03
445	300337	银邦股份	6,300	49,581.00	0.03
446	002486	嘉麟杰	10,500	49,140.00	0.03
447	300204	舒泰神	2,158	39,793.52	0.02
448	002401	中海科技	2,100	38,514.00	0.02
449	002069	*ST 獐岛	4,200	35,490.00	0.02
450	002605	姚记扑克	2,100	34,251.00	0.02
451	002461	珠江啤酒	2,199	25,552.38	0.02

### 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

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所有资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

#### 7.9 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	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	
长江证券股份有限公司	2	47,012,754.23	64.08%	32,913.49	64.08%	新增 1 个
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	1	-	-	-	-	-

有限公司						
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 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
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%

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实中创 400ETF 基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 3 月 24 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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。

### 11.2 存放地点

北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

### 11.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司  
2016 年 8 月 27 日