

# 中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告

2016 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：2017 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。

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 2017 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人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.....	14
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
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.....	45
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.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
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.....	61

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
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 .....	63
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 .....	63
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
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 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
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 .....	66
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## § 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	75,561,264.00 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	郭明
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	400-600-8800	95588
传真	(010) 65182266	(010)66105798
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	100005	100140
法定代表人	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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-4,770,550.20	19,403,013.03	27,031,337.63
本期利润	-36,752,170.34	24,510,785.16	24,515,437.59
加权平均基金份额本期利润	-0.4660	0.3583	0.2582
本期加权平均净值利润率	-22.61%	14.99%	17.66%
本期基金份额净值增长率	-21.62%	63.33%	22.44%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配利润	59,048,424.92	56,925,255.68	38,480,009.26
期末可供分配基金份额利润	0.7815	0.8426	0.5026
期末基金资产净值	150,963,392.57	172,214,937.48	119,483,911.89
期末基金份额净值	1.9979	2.5490	1.5606
3.1.3 累计期末指标	2016年末	2015年末	2014年末

基金份额累计净值增长率	99.79%	154.90%	56.06%
-------------	--------	---------	--------

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。

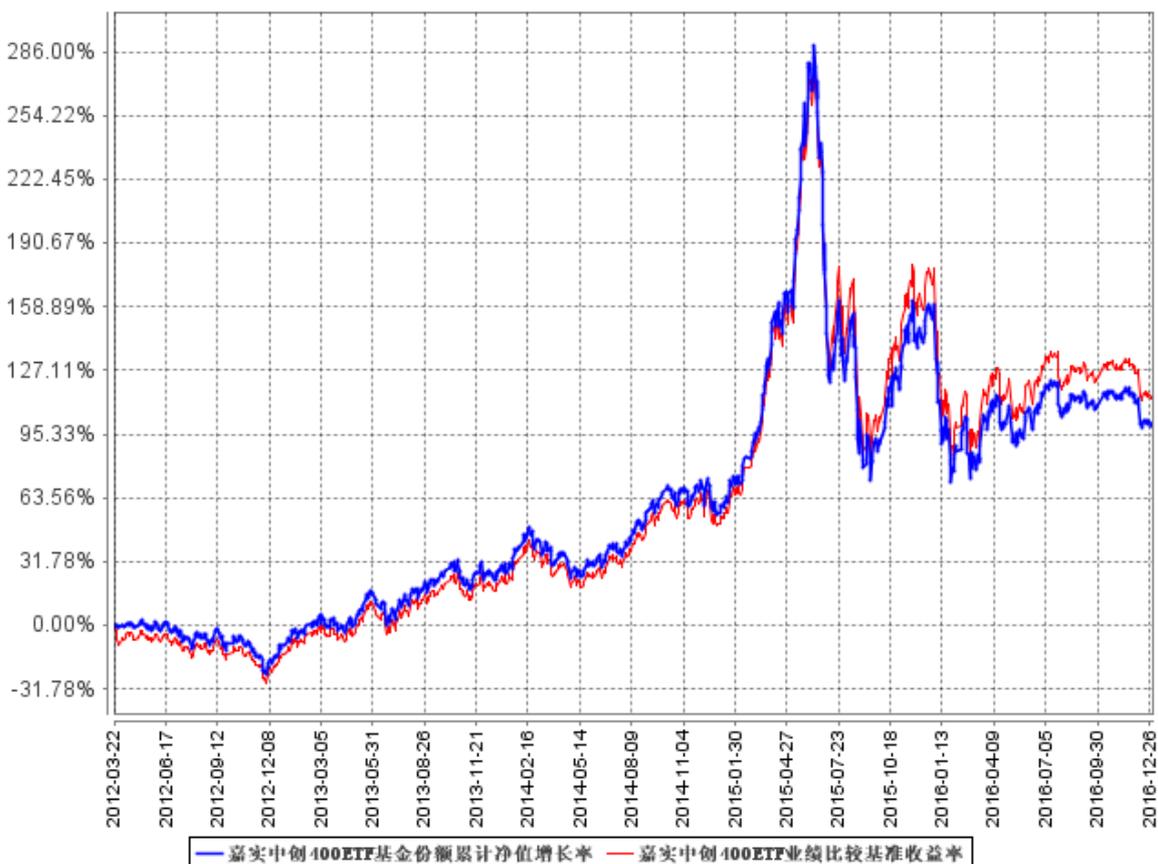
## 3.2 基金净值表现

### 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	-4.95%	0.93%	-4.77%	0.94%	-0.18%	-0.01%
过去六个月	-7.35%	1.01%	-7.03%	1.02%	-0.32%	-0.01%
过去一年	-21.62%	2.06%	-21.60%	2.07%	-0.02%	-0.01%
过去三年	56.75%	2.14%	75.16%	2.18%	-18.41%	-0.04%
自基金合同生效起至今	99.79%	1.92%	113.56%	1.97%	-13.77%	-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

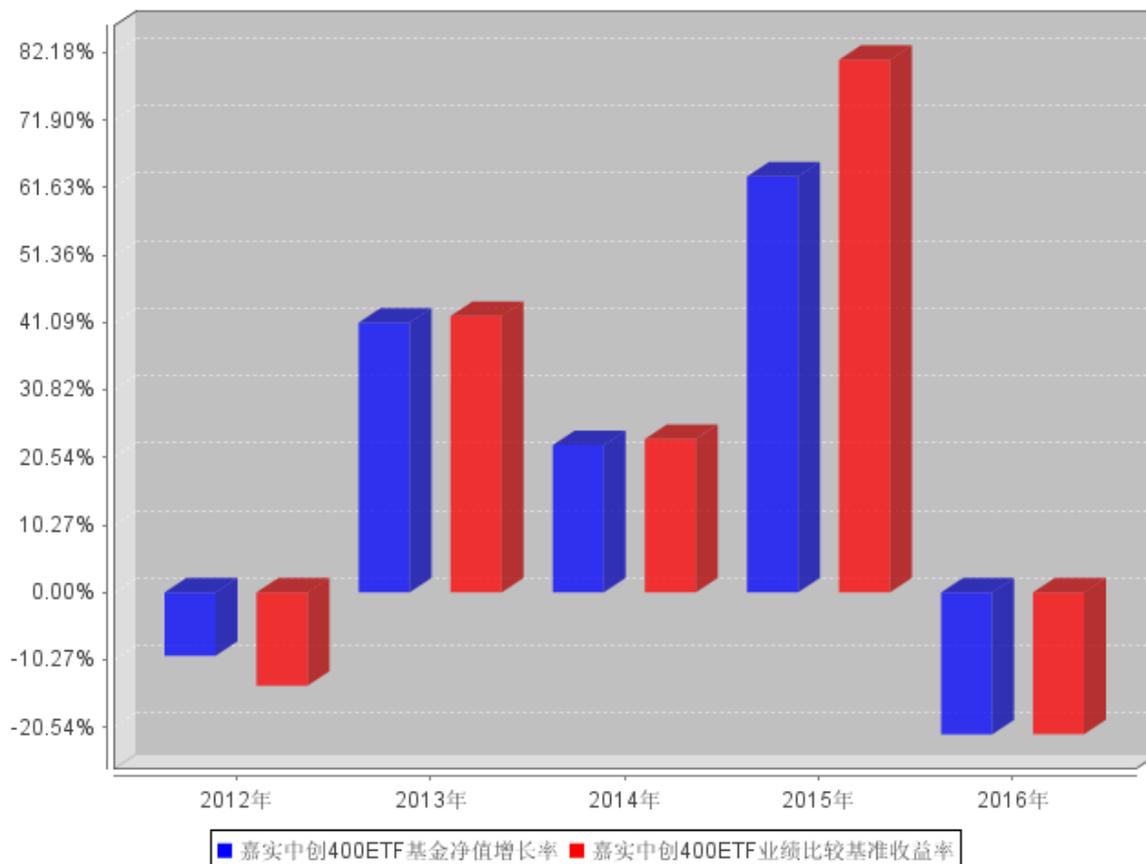
(2012 年 3 月 22 日至 2016 年 12 月 31 日)

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。

### 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2016年12月31日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、111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、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态混合、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、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券。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、离任日期是指公司作出决定后公告之日;(2) 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《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 6 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

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 指数下跌 21.60%。

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.02%，年度化拟合偏离度为 0.37%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2%的限制。

本基金的跟踪误差主要来源于基金的申购赎回、样本股停牌、样本股分红以及样本股调整的冲击。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.9979 元；本报告期基金份额净值增长率为-21.62%，业绩比较基准收益率为-21.60%。

## 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 2017 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 指数具有长期的投资价值。

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。对于新产品、新业务，从战略规划到具体产品方案，在投资范围、投资工具、运作规则等方面，重点关注防控风

险。

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

#### 4.8 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。

#### 4.9 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 2016 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(2017)第 20611 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 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天  
会计师事务所(特殊普通合伙)  
中国·上海市

注册会计师

许康玮

张勇

2017 年 3 月 22 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: 2016 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,370,651.76	1,675,294.88
结算备付金		14,578.13	232,372.66
存出保证金		691.85	31,889.82
交易性金融资产	7.4.7.2	149,625,089.55	170,685,191.45
其中: 股票投资		149,625,089.55	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		334,595.02	-
应收利息	7.4.7.5	251.47	298.75
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		151,345,857.78	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12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	21,925.95
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		65,325.30	72,638.62
应付托管费		13,065.10	14,527.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	10,873.46	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	7.4.7.8	293,201.35	285,000.00
负债合计		382,465.21	410,110.08
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	75,561,264.00	67,561,264.00
未分配利润	7.4.7.10	75,402,128.57	104,653,673.48
所有者权益合计		150,963,392.57	172,214,937.48
负债和所有者权益总计		151,345,857.78	172,625,047.56

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9979 元，基金份额总额 75,561,264.00 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
<b>一、收入</b>		-35,068,002.34	26,371,827.20
1.利息收入		11,116.55	22,001.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	11,087.30	22,001.74

债券利息收入		29.25	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-3,090,822.66	20,642,000.40
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3,773,982.19	20,119,329.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	22,847.98	-
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	660,311.55	522,670.67
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	-31,981,620.14	5,107,772.13
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	-6,676.09	600,052.93
<b>减：二、费用</b>		1,684,168.00	1,861,042.04
1. 管理人报酬		811,612.96	807,724.12
2. 托管费		162,322.55	161,544.95
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	139,918.49	321,440.97
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	570,314.00	570,332.00
<b>三、利润总额</b>		-36,752,170.34	24,510,785.16
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		-36,752,170.34	24,510,785.16

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	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）	-	-36,752,170.34	-36,752,170.34
三、本期基金份额交易	8,000,000.00	7,500,625.43	15,500,625.43

产生的基金净值变动数			
其中：1.基金申购款	40,000,000.00	42,496,492.70	82,496,492.70
2.基金赎回款	-32,000,000.00	-34,995,867.27	-66,995,867.27
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）	75,561,264.00	75,402,128.57	150,963,392.57
项目	上年度可比期间 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

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

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

## 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有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、资产支持证券投资和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分配的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

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	1,370,651.76	1,675,294.88
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,370,651.76	1,675,294.88

注：定期存款的存款期限指票面存期。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	162,476,250.68	149,625,089.55	-12,851,161.13
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	162,476,250.68	149,625,089.55	-12,851,161.13
项目	上年度末 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

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（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 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（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 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（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	237.14	272.32
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	14.03	12.03
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	0.30	14.40
合计	251.47	298.75

### 7.4.7.6 其他资产

本期末（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	10,873.46	16,017.76
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	10,873.46	16,017.76
----	-----------	-----------

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	210,000.00
应付指数使用费	75,000.00	75,000.00
可退替代款	8,201.35	-
其他	-	-
合计	293,201.35	285,000.00

#### 7.4.7.9 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12月31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	40,000,000.00	40,000,000.00
本期赎回	-32,000,000.00	-32,000,000.00
本期末	75,561,264.00	75,561,264.00

#### 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	56,925,255.68	47,728,417.80	104,653,673.48
本期利润	-4,770,550.20	-31,981,620.14	-36,752,170.34
本期基金份额交易产生的变动数	6,893,719.44	606,905.99	7,500,625.43
其中：基金申购款	32,918,016.78	9,578,475.92	42,496,492.70
基金赎回款	-26,024,297.34	-8,971,569.93	-34,995,867.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,048,424.92	16,353,703.65	75,402,128.57

## 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
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	9,693.63	16,939.54
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	1,333.83	4,830.78
其他	59.84	231.42
合计	11,087.30	22,001.74

## 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-654,398.31	141,285.46
股票投资收益——赎回差价收入	-3,119,583.88	19,978,044.27
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-3,773,982.19	20,119,329.73

## 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	54,031,575.84	120,129,727.11
减：卖出股票成本总额	54,685,974.15	119,988,441.65
买卖股票差价收入	-654,398.31	141,285.46

## 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
赎回基金份额对价总额	66,995,867.27	245,420,845.70

减：现金支付赎回款总额	4,432,570.27	39,429,873.70
减：赎回股票成本总额	65,682,880.88	186,012,927.73
赎回差价收入	-3,119,583.88	19,978,044.27

#### 7.4.7.13 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 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	128,977.23	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	106,100.00	-
减：应收利息总额	29.25	-
买卖债券差价收入	22,847.98	-

注：上年度可比期间（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（2016年1月1日至2016年12月31日）及上年度可比期间（2015年1月1日至2015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 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
股票投资产生的股利收益	660,311.55	522,670.67
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	660,311.55	522,670.67

#### 7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-31,981,620.14	5,107,772.13
——股票投资	-31,981,620.14	5,107,772.13
——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	-31,981,620.14	5,107,772.13

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31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	-6,676.09	600,052.93
其他	-	-
合计	-6,676.09	600,052.93

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31 日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
交易所市场交易费用	139,918.49	321,440.97
银行间市场交易费用	-	-
合计	139,918.49	321,440.97

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	150,000.00	150,000.00
债券托管账户维护费	-	-
银行划款手续费	314.00	332.00
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	-	-
合计	570,314.00	570,332.00

## 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

财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，要求 2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

上述通知是对财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)的补充，该通知要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

## 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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	811,612.96	807,724.12
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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	162,322.55	161,544.95

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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 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

本报告期内（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015

年 12 月 31 日)，基金管理人未运用自有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

#### 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 2016 年 12 月 31 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	71,684,808.00	94.87%	62,684,808.00	92.78%

#### 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	1,370,651.76	9,693.63	1,675,294.88	16,939.54

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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日），本基金未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末（2016 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（2016 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
----------	----------	----------	----------	----------------	----------	----------------	-------	------------	------------	----

300088	长信科技	2016年9月12日	重大事项停牌	15.80	-	-	66,500	872,998.10	1,050,700.00	-
002075	沙钢股份	2016年9月19日	重大事项停牌	16.12	-	-	51,500	550,827.53	830,180.00	-
002462	嘉事堂	2016年9月28日	重大事项停牌	42.53	2017年1月12日	38.98	13,400	576,807.47	569,902.00	-
002491	通鼎互联	2016年12月22日	重大事项停牌	15.54	2017年1月3日	15.89	35,400	558,942.74	550,116.00	-
002602	世纪华通	2016年12月15日	重大事项停牌	46.89	2017年1月9日	50.00	11,200	233,822.24	525,168.00	-
300367	东方网力	2016年12月15日	重大事项停牌	20.04	-	-	24,800	607,729.73	496,992.00	-
300271	华宇软件	2016年12月19日	重大事项停牌	17.45	-	-	28,267	538,916.15	493,259.15	-
300098	高新兴	2016年11月17日	重大事项停牌	15.84	2017年1月23日	14.26	31,000	495,028.66	491,040.00	-
002440	闰土股份	2016年10月21日	重大事项停牌	16.34	2017年1月12日	15.22	29,392	560,339.36	480,265.28	-
300212	易华录	2016年11月30日	重大事项停牌	34.00	-	-	13,797	597,683.73	469,098.00	-
002025	航天电器	2016年9月12日	重大事项停牌	25.20	-	-	17,504	415,766.28	441,100.80	-
002396	星网锐捷	2016年9月12日	重大事项停牌	19.70	2017年2月21日	18.35	21,693	472,543.37	427,352.10	-
300065	海兰信	2016年12月8日	重大事项停牌	38.52	-	-	10,400	304,574.85	400,608.00	-

300496	中科创达	2016年10月11日	重大事项停牌	52.28	2017年1月6日	47.49	7,300	493,485.27	381,644.00	-
300047	天源迪科	2016年8月15日	重大事项停牌	19.90	2017年1月6日	19.00	19,100	382,151.97	380,090.00	-
002151	北斗星通	2016年11月16日	重大事项停牌	31.90	2017年1月12日	31.00	11,377	337,658.09	362,926.30	-
300005	探路者	2016年11月28日	重大事项停牌	16.69	2017年2月6日	15.02	21,444	465,222.69	357,900.36	-
002156	通富微电	2016年12月28日	重大事项停牌	11.38	2017年1月5日	11.65	30,844	362,048.51	351,004.72	-
002260	德奥通航	2016年12月5日	重大事项停牌	23.10	-	-	14,800	387,398.41	341,880.00	-
002635	安洁科技	2016年11月8日	重大事项停牌	36.40	2017年2月8日	33.50	9,000	214,657.86	327,600.00	-
002071	长城影视	2016年6月16日	重大事项停牌	13.64	2017年1月3日	15.00	21,800	393,596.09	297,352.00	-
002297	博云新材	2016年6月20日	重大事项停牌	13.09	2017年1月4日	13.40	22,050	297,692.40	288,634.50	-
002664	信质电机	2016年12月16日	重大事项停牌	25.39	-	-	10,700	307,676.14	271,673.00	-
002727	一心堂	2016年12月28日	重大事项停牌	21.20	2017年1月5日	21.66	12,800	311,699.78	271,360.00	-
002681	奋达科技	2016年12月19日	重大事项停牌	12.93	-	-	19,800	335,173.97	256,014.00	-
002571	德力股份	2016年8月2日	重大事项停牌	15.33	2017年2月28日	15.44	15,500	208,999.16	237,615.00	-

002226	江南化工	2016年11月11日	重大事项停牌	8.61	2017年3月1日	9.20	26,022	237,991.35	224,049.42	-
300276	三丰智能	2016年9月12日	重大事项停牌	18.15	-	-	10,600	231,361.79	192,390.00	-

### 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（2016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（2016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 2016 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	1,370,651.76	-	-	-	1,370,651.76
结算备付金	14,578.13	-	-	-	14,578.13
存出保证金	691.85	-	-	-	691.85
交易性金融资产	-	-	-	149,625,089.55	149,625,089.55
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	334,595.02	334,595.02
应收利息	-	-	-	251.47	251.47
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,385,921.74	-	-	149,959,936.04	151,345,857.78
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	65,325.30	65,325.30
应付托管费	-	-	-	13,065.10	13,065.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	10,873.46	10,873.46
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	293,201.35	293,201.35
负债总计	-	-	-	382,465.21	382,465.21
利率敏感度缺口	1,385,921.74	-	-	149,577,470.83	150,963,392.57
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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 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(2015 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 2016年12月31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	149,625,089.55	99.11	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	149,625,089.55	99.11	170,685,191.45	99.11

#### 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（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	7,490,208.70	8,357,982.70
业绩比较基准下降5%	-7,490,208.70	-8,357,982.70	

#### 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 137,857,174.92 元，属于第二层次的余额为 11,767,914.63 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。

## § 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	149,625,089.55	98.86
	其中：股票	149,625,089.55	98.86
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	1,385,229.89	0.92
7	其他各项资产	335,538.34	0.22
8	合计	151,345,857.78	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	2,811,314.62	1.86
B	采矿业	1,413,781.10	0.94
C	制造业	104,193,844.35	69.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,051,819.82	0.70
E	建筑业	3,607,494.31	2.39
F	批发和零售业	4,845,312.45	3.21
G	交通运输、仓储和邮政业	606,583.76	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,308,901.13	14.78
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,006,547.20	0.67
L	租赁和商务服务业	1,939,476.00	1.28
M	科学研究和技术服务业	1,003,819.32	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	254,610.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,301,163.56	0.86
R	文化、体育和娱乐业	2,991,787.43	1.98
S	综合	-	-
	合计	149,336,455.05	98.92

### 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	288,634.50	0.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	288,634.50	0.19

### 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	300136	信维通信	41,900	1,194,150.00	0.79
2	300088	长信科技	66,500	1,050,700.00	0.70
3	002085	万丰奥威	50,944	1,006,653.44	0.67
4	300156	神雾环保	34,495	862,719.95	0.57
5	300115	长盈精密	32,060	835,483.60	0.55
6	300266	兴源环境	15,200	834,176.00	0.55
7	002075	沙钢股份	51,500	830,180.00	0.55
8	002572	索菲亚	15,300	828,648.00	0.55
9	002508	老板电器	22,266	819,388.80	0.54
10	002092	中泰化学	66,900	809,490.00	0.54
11	300408	三环集团	49,000	778,120.00	0.52
12	002168	深圳惠程	46,073	730,717.78	0.48
13	002271	东方雨虹	32,642	708,004.98	0.47
14	300296	利亚德	20,500	691,260.00	0.46
15	002221	东华能源	52,976	656,372.64	0.43
16	300142	沃森生物	58,340	635,906.00	0.42
17	002311	海大集团	42,100	633,605.00	0.42
18	300015	爱尔眼科	21,175	633,132.50	0.42
19	002665	首航节能	71,550	626,778.00	0.42
20	002018	华信国际	61,388	624,315.96	0.41
21	002407	多氟多	22,805	622,348.45	0.41
22	002013	中航机电	33,665	615,732.85	0.41
23	002074	国轩高科	19,789	613,261.11	0.41
24	300134	大富科技	23,300	590,888.00	0.39
25	300207	欣旺达	42,176	586,246.40	0.39
26	002131	利欧股份	36,474	581,760.30	0.39
27	300203	聚光科技	19,000	580,450.00	0.38
28	002299	圣农发展	27,100	575,062.00	0.38
29	002622	融钰集团	39,400	574,452.00	0.38
30	002048	宁波华翔	25,800	571,212.00	0.38
31	002462	嘉事堂	13,400	569,902.00	0.38
32	002280	联络互动	40,500	565,785.00	0.37
33	002501	利源精制	46,000	564,420.00	0.37

34	300216	千山药机	16,600	563,238.00	0.37
35	300324	旋极信息	28,900	558,637.00	0.37
36	002138	顺络电子	32,194	557,278.14	0.37
37	002250	联化科技	34,200	553,356.00	0.37
38	002050	三花智控	50,044	552,485.76	0.37
39	002491	通鼎互联	35,400	550,116.00	0.36
40	002583	海能达	41,090	542,798.90	0.36
41	002426	胜利精密	64,700	535,069.00	0.35
42	300267	尔康制药	41,000	535,050.00	0.35
43	002544	杰赛科技	18,984	534,209.76	0.35
44	002343	慈文传媒	11,800	533,006.00	0.35
45	002477	雏鹰农牧	105,887	531,552.74	0.35
46	002408	齐翔腾达	48,071	528,781.00	0.35
47	002602	世纪华通	11,200	525,168.00	0.35
48	300090	盛运环保	45,180	524,088.00	0.35
49	300068	南都电源	27,175	523,662.25	0.35
50	002155	湖南黄金	44,800	512,960.00	0.34
51	002308	威创股份	34,643	510,637.82	0.34
52	002281	光迅科技	6,504	510,564.00	0.34
53	300287	飞利信	42,900	510,510.00	0.34
54	002384	东山精密	26,000	509,860.00	0.34
55	002185	华天科技	41,948	506,731.84	0.34
56	300026	红日药业	93,200	506,076.00	0.34
57	002389	南洋科技	21,882	505,036.56	0.33
58	002078	太阳纸业	75,404	503,698.72	0.33
59	300367	东方网力	24,800	496,992.00	0.33
60	300271	华宇软件	28,267	493,259.15	0.33
61	002714	牧原股份	21,100	491,208.00	0.33
62	300098	高新兴	31,000	491,040.00	0.33
63	300182	捷成股份	47,414	488,838.34	0.32
64	002268	卫士通	15,482	486,444.44	0.32
65	002444	巨星科技	31,100	485,160.00	0.32
66	300078	思创医惠	18,700	484,517.00	0.32
67	002640	跨境通	26,300	481,290.00	0.32
68	002440	闰土股份	29,392	480,265.28	0.32
69	300347	泰格医药	17,706	478,239.06	0.32
70	002668	奥马电器	6,700	475,365.00	0.31
71	002595	豪迈科技	22,540	474,467.00	0.31
72	300212	易华录	13,797	469,098.00	0.31

73	002023	海特高新	33,780	467,515.20	0.31
74	300166	东方国信	22,436	466,444.44	0.31
75	002630	华西能源	37,760	465,580.80	0.31
76	300197	铁汉生态	36,672	465,000.96	0.31
77	002479	富春环保	31,201	462,398.82	0.31
78	300291	华录百纳	20,747	462,243.16	0.31
79	300199	翰宇药业	25,700	462,086.00	0.31
80	002217	合力泰	25,800	461,820.00	0.31
81	300274	阳光电源	43,740	461,019.60	0.31
82	002019	亿帆医药	30,150	460,993.50	0.31
83	002411	必康股份	16,979	459,281.95	0.30
84	002073	软控股份	40,300	457,405.00	0.30
85	002522	浙江众成	25,400	456,946.00	0.30
86	300159	新研股份	33,600	456,288.00	0.30
87	300001	特锐德	26,274	455,591.16	0.30
88	300113	顺网科技	16,694	448,901.66	0.30
89	002117	东港股份	14,956	447,932.20	0.30
90	002070	众和股份	32,134	446,019.92	0.30
91	002326	永太科技	27,300	445,263.00	0.29
92	300010	立思辰	26,779	445,066.98	0.29
93	002672	东江环保	25,275	444,840.00	0.29
94	002041	登海种业	23,500	443,680.00	0.29
95	002244	滨江集团	63,500	443,230.00	0.29
96	002570	贝因美	33,700	442,144.00	0.29
97	002025	航天电器	17,504	441,100.80	0.29
98	002421	达实智能	66,980	440,728.40	0.29
99	300020	银江股份	27,921	440,593.38	0.29
100	002002	鸿达兴业	59,715	438,308.10	0.29
101	300118	东方日升	26,648	437,826.64	0.29
102	300352	北信源	22,440	435,560.40	0.29
103	002390	信邦制药	44,000	435,160.00	0.29
104	002368	太极股份	14,208	434,906.88	0.29
105	002047	宝鹰股份	46,500	434,775.00	0.29
106	002303	美盈森	42,000	431,760.00	0.29
107	300101	振芯科技	23,148	429,163.92	0.28
108	002366	台海核电	8,000	428,960.00	0.28
109	002436	兴森科技	62,428	427,631.80	0.28
110	002396	星网锐捷	21,693	427,352.10	0.28
111	002052	同洲电子	38,068	426,361.60	0.28

112	300012	华测检测	36,500	421,575.00	0.28
113	002067	景兴纸业	62,931	420,379.08	0.28
114	002028	思源电气	31,660	417,278.80	0.28
115	002603	以岭药业	24,200	417,208.00	0.28
116	300053	欧比特	29,428	416,994.76	0.28
117	002224	三力士	27,600	415,104.00	0.27
118	002589	瑞康医药	12,700	412,115.00	0.27
119	300376	易事特	8,600	412,112.00	0.27
120	300122	智飞生物	25,000	411,750.00	0.27
121	002429	兆驰股份	41,300	411,348.00	0.27
122	002099	海翔药业	48,272	409,346.56	0.27
123	002285	世联行	53,667	407,869.20	0.27
124	002638	勤上光电	44,300	407,560.00	0.27
125	002325	洪涛股份	50,771	406,675.71	0.27
126	002089	新海宜	28,579	405,536.01	0.27
127	002358	森源电气	21,112	404,928.16	0.27
128	300009	安科生物	18,947	403,950.04	0.27
129	002481	双塔食品	44,385	402,571.95	0.27
130	002161	远望谷	34,800	401,244.00	0.27
131	300065	海兰信	10,400	400,608.00	0.27
132	002108	沧州明珠	19,590	399,048.30	0.26
133	002094	青岛金王	13,179	395,370.00	0.26
134	002437	誉衡药业	47,800	395,306.00	0.26
135	300238	冠昊生物	11,800	393,530.00	0.26
136	300054	鼎龙股份	18,005	393,409.25	0.26
137	300284	苏交科	18,900	393,120.00	0.26
138	300096	易联众	24,929	388,643.11	0.26
139	002055	得润电子	16,372	388,180.12	0.26
140	002373	千方科技	27,700	382,260.00	0.25
141	300148	天舟文化	18,322	382,196.92	0.25
142	300496	中科创达	7,300	381,644.00	0.25
143	300377	赢时胜	10,200	380,766.00	0.25
144	300047	天源迪科	19,100	380,090.00	0.25
145	300257	开山股份	22,100	379,236.00	0.25
146	002313	日海通讯	16,189	377,203.70	0.25
147	002505	大康农业	106,250	376,125.00	0.25
148	002123	梦网荣信	25,073	376,095.00	0.25
149	002106	莱宝高科	33,400	375,416.00	0.25
150	002262	恩华药业	17,946	375,071.40	0.25

151	002428	云南锗业	29,600	375,032.00	0.25
152	002237	恒邦股份	32,600	374,900.00	0.25
153	300202	聚龙股份	15,200	373,920.00	0.25
154	002467	二六三	35,456	372,997.12	0.25
155	002043	兔宝宝	32,200	372,554.00	0.25
156	002284	亚太股份	26,400	371,448.00	0.25
157	002005	德豪润达	64,500	370,875.00	0.25
158	002174	游族网络	13,988	369,982.60	0.25
159	300147	香雪制药	28,566	368,501.40	0.24
160	002031	巨轮智能	107,610	366,950.10	0.24
161	300011	鼎汉技术	17,700	366,744.00	0.24
162	002317	众生药业	29,500	364,325.00	0.24
163	002283	天润曲轴	46,854	364,055.58	0.24
164	002261	拓维信息	30,500	363,560.00	0.24
165	002151	北斗星通	11,377	362,926.30	0.24
166	002480	新筑股份	31,888	361,928.80	0.24
167	002097	山河智能	40,391	361,499.45	0.24
168	002121	科陆电子	40,673	358,735.86	0.24
169	300364	中文在线	9,065	358,248.80	0.24
170	300005	探路者	21,444	357,900.36	0.24
171	002555	三七互娱	21,760	356,864.00	0.24
172	002512	达华智能	21,850	356,810.50	0.24
173	002474	榕基软件	26,288	356,465.28	0.24
174	002431	棕榈股份	38,753	354,977.48	0.24
175	002550	千红制药	49,152	354,877.44	0.24
176	002277	友阿股份	24,700	354,692.00	0.23
177	002130	沃尔核材	25,080	354,129.60	0.23
178	002263	大东南	83,706	354,076.38	0.23
179	002588	史丹利	31,060	352,531.00	0.23
180	002339	积成电子	18,508	352,392.32	0.23
181	300359	全通教育	17,800	352,262.00	0.23
182	300316	晶盛机电	29,300	351,014.00	0.23
183	002156	通富微电	30,844	351,004.72	0.23
184	002269	美邦服饰	69,800	349,698.00	0.23
185	002418	康盛股份	34,100	348,843.00	0.23
186	300463	迈克生物	14,200	348,610.00	0.23
187	002056	横店东磁	25,000	347,750.00	0.23
188	002245	澳洋顺昌	38,978	347,683.76	0.23
189	300252	金信诺	11,700	347,607.00	0.23

190	002344	海宁皮城	30,700	347,524.00	0.23
191	300043	星辉娱乐	34,140	346,179.60	0.23
192	002463	沪电股份	72,154	344,896.12	0.23
193	002433	太安堂	31,773	344,419.32	0.23
194	002145	中核钛白	56,000	343,280.00	0.23
195	300297	蓝盾股份	27,552	342,746.88	0.23
196	002210	飞马国际	18,544	342,136.80	0.23
197	002260	德奥通航	14,800	341,880.00	0.23
198	002126	银轮股份	35,234	341,417.46	0.23
199	002482	广田集团	36,863	340,982.75	0.23
200	002249	大洋电机	39,488	340,781.44	0.23
201	002476	宝莫股份	32,500	339,950.00	0.23
202	002341	新纶科技	16,112	339,802.08	0.23
203	002447	壹桥股份	34,276	338,646.88	0.22
204	002468	申通快递	11,200	338,464.00	0.22
205	002318	久立特材	33,828	338,280.00	0.22
206	002547	春兴精工	35,600	336,420.00	0.22
207	002256	兆新股份	52,272	335,586.24	0.22
208	002215	诺普信	30,265	335,336.20	0.22
209	300157	恒泰艾普	36,450	334,975.50	0.22
210	002563	森马服饰	32,600	334,802.00	0.22
211	002376	新北洋	26,997	334,762.80	0.22
212	300131	英唐智控	34,700	333,120.00	0.22
213	002364	中恒电气	16,000	332,800.00	0.22
214	002471	中超控股	54,900	332,694.00	0.22
215	002413	雷科防务	28,700	332,346.00	0.22
216	002128	露天煤业	38,600	331,960.00	0.22
217	300336	新文化	16,867	331,436.55	0.22
218	002503	搜于特	23,027	331,358.53	0.22
219	002091	江苏国泰	24,950	330,837.00	0.22
220	300110	华仁药业	21,400	330,630.00	0.22
221	002254	泰和新材	26,740	330,506.40	0.22
222	002329	皇氏集团	23,400	330,408.00	0.22
223	002721	金一文化	19,800	330,264.00	0.22
224	300183	东软载波	13,314	329,122.08	0.22
225	002517	恺英网络	9,800	328,888.00	0.22
226	300039	上海凯宝	32,044	327,810.12	0.22
227	002497	雅化集团	47,778	327,757.08	0.22
228	002635	安洁科技	9,000	327,600.00	0.22

229	002642	荣之联	16,291	327,449.10	0.22
230	002649	博彦科技	8,400	326,760.00	0.22
231	002242	九阳股份	18,100	326,343.00	0.22
232	002180	艾派克	11,575	325,489.00	0.22
233	002663	普邦股份	53,354	323,858.78	0.21
234	002690	美亚光电	15,300	323,748.00	0.21
235	002367	康力电梯	24,334	321,452.14	0.21
236	002699	美盛文化	9,500	321,100.00	0.21
237	002448	中原内配	29,000	320,160.00	0.21
238	300355	蒙草生态	31,900	319,957.00	0.21
239	002650	加加食品	45,350	319,264.00	0.21
240	002251	步步高	19,209	315,988.05	0.21
241	300014	亿纬锂能	10,802	315,418.40	0.21
242	002488	金固股份	19,000	315,400.00	0.21
243	002625	龙生股份	8,400	314,664.00	0.21
244	002011	盾安环境	32,700	311,304.00	0.21
245	002170	芭田股份	33,284	309,208.36	0.20
246	002502	骅威文化	23,700	306,204.00	0.20
247	002177	御银股份	39,802	304,883.32	0.20
248	300032	金龙机电	18,890	303,940.10	0.20
249	300231	银信科技	16,400	303,564.00	0.20
250	300332	天壕环境	32,200	302,680.00	0.20
251	300222	科大智能	15,100	302,000.00	0.20
252	300269	联建光电	13,000	300,560.00	0.20
253	002371	七星电子	11,268	299,728.80	0.20
254	002556	辉隆股份	28,844	299,689.16	0.20
255	300226	上海钢联	7,396	298,946.32	0.20
256	300034	钢研高纳	15,276	297,729.24	0.20
257	002498	汉缆股份	69,200	297,560.00	0.20
258	002071	长城影视	21,800	297,352.00	0.20
259	300228	富瑞特装	23,240	297,239.60	0.20
260	002095	生意宝	7,420	297,096.80	0.20
261	300075	数字政通	15,900	296,376.00	0.20
262	002443	金洲管道	26,932	294,636.08	0.20
263	002449	国星光电	22,100	293,488.00	0.19
264	002020	京新药业	25,892	293,097.44	0.19
265	300302	同有科技	13,100	291,606.00	0.19
266	300178	腾邦国际	17,980	290,197.20	0.19
267	300128	锦富新材	17,291	289,624.25	0.19

268	002157	正邦科技	43,357	288,757.62	0.19
269	002610	爱康科技	87,700	286,779.00	0.19
270	002267	陕天然气	29,900	286,741.00	0.19
271	300031	宝通科技	13,600	286,688.00	0.19
272	300083	劲胜精密	39,000	286,650.00	0.19
273	002296	辉煌科技	18,020	284,535.80	0.19
274	300379	东方通	4,100	284,499.00	0.19
275	002697	红旗连锁	35,170	284,173.60	0.19
276	002354	天神娱乐	4,100	283,556.00	0.19
277	002143	印纪传媒	8,800	283,448.00	0.19
278	002414	高德红外	12,386	282,153.08	0.19
279	002298	中电鑫龙	20,400	281,724.00	0.19
280	002197	证通电子	17,272	281,706.32	0.19
281	002551	尚荣医疗	14,112	280,969.92	0.19
282	002229	鸿博股份	11,900	280,126.00	0.19
283	300137	先河环保	19,100	278,860.00	0.18
284	300339	润和软件	9,100	278,460.00	0.18
285	002416	爱施德	18,900	278,397.00	0.18
286	002655	共达电声	19,737	276,712.74	0.18
287	002064	华峰氨纶	50,300	276,147.00	0.18
288	002093	国脉科技	24,800	274,536.00	0.18
289	300224	正海磁材	14,802	274,133.04	0.18
290	002445	中南文化	18,100	271,681.00	0.18
291	002664	信质电机	10,700	271,673.00	0.18
292	002079	苏州固锔	29,607	271,496.19	0.18
293	002727	一心堂	12,800	271,360.00	0.18
294	002355	兴民智通	19,800	269,082.00	0.18
295	002604	龙力生物	23,543	267,683.91	0.18
296	002309	中利科技	18,784	266,920.64	0.18
297	002600	江粉磁材	26,000	266,240.00	0.18
298	002288	超华科技	32,584	264,907.92	0.18
299	002581	未名医药	10,800	262,116.00	0.17
300	300300	汉鼎宇佑	12,500	262,000.00	0.17
301	002709	天赐材料	6,200	261,454.00	0.17
302	300333	兆日科技	15,400	261,338.00	0.17
303	300004	南风股份	18,204	260,863.32	0.17
304	002369	卓翼科技	25,482	260,426.04	0.17
305	300369	绿盟科技	7,650	259,870.50	0.17
306	002711	欧浦智网	17,260	258,900.00	0.17

307	002240	威华股份	22,376	258,890.32	0.17
308	002773	康弘药业	4,550	258,394.50	0.17
309	002032	苏泊尔	7,392	258,128.64	0.17
310	002253	川大智胜	10,340	257,879.60	0.17
311	300413	快乐购	11,200	257,376.00	0.17
312	002118	紫鑫药业	35,702	257,054.40	0.17
313	300177	中海达	17,280	256,608.00	0.17
314	002681	奋达科技	19,800	256,014.00	0.17
315	002564	天沃科技	25,600	256,000.00	0.17
316	002542	中化岩土	31,450	254,745.00	0.17
317	300152	科融环境	34,500	254,610.00	0.17
318	002496	辉丰股份	51,287	253,870.65	0.17
319	002737	葵花药业	7,500	252,675.00	0.17
320	002631	德尔未来	13,600	252,552.00	0.17
321	002636	金安国纪	15,400	251,790.00	0.17
322	300045	华力创通	18,800	249,476.00	0.17
323	002148	北纬通信	12,996	247,703.76	0.16
324	300016	北陆药业	13,400	247,498.00	0.16
325	300111	向日葵	46,139	243,152.53	0.16
326	002568	百润股份	12,000	242,880.00	0.16
327	002154	报喜鸟	44,760	242,599.20	0.16
328	300171	东富龙	16,156	240,562.84	0.16
329	300006	莱美药业	28,456	240,453.20	0.16
330	300368	汇金股份	10,900	237,838.00	0.16
331	002571	德力股份	15,500	237,615.00	0.16
332	002493	荣盛石化	15,400	237,468.00	0.16
333	300188	美亚柏科	11,100	237,429.00	0.16
334	002751	易尚展示	5,100	236,844.00	0.16
335	002331	皖通科技	13,260	236,028.00	0.16
336	300386	飞天诚信	9,280	234,876.80	0.16
337	300191	潜能恒信	6,799	233,885.60	0.15
338	002036	联创电子	12,200	233,752.00	0.15
339	300439	美康生物	7,600	229,444.00	0.15
340	002111	威海广泰	10,654	227,995.60	0.15
341	002345	潮宏基	18,694	225,823.52	0.15
342	002332	仙琚制药	17,412	224,092.44	0.15
343	002226	江南化工	26,022	224,049.42	0.15
344	002717	岭南园林	8,600	223,428.00	0.15
345	300295	三六五网	7,712	222,799.68	0.15

346	002609	捷顺科技	13,800	220,800.00	0.15
347	002029	七匹狼	21,600	220,536.00	0.15
348	002432	九安医疗	14,088	218,786.64	0.14
349	300245	天玑科技	12,650	216,441.50	0.14
350	002279	久其软件	12,550	215,232.50	0.14
351	300093	金刚玻璃	8,800	214,808.00	0.14
352	002698	博实股份	13,616	212,001.12	0.14
353	002504	弘高创意	26,693	211,141.63	0.14
354	300288	朗玛信息	7,694	210,430.90	0.14
355	300229	拓尔思	12,534	206,936.34	0.14
356	002235	安妮股份	12,950	206,164.00	0.14
357	300064	豫金刚石	18,006	204,368.10	0.14
358	002702	海欣食品	10,700	203,728.00	0.13
359	002334	英威腾	24,932	201,949.20	0.13
360	002037	久联发展	11,583	198,300.96	0.13
361	300485	赛升药业	4,600	197,018.00	0.13
362	300049	福瑞股份	9,400	196,930.00	0.13
363	002203	海亮股份	24,400	196,664.00	0.13
364	300276	三丰智能	10,600	192,390.00	0.13
365	002044	美年健康	14,400	189,792.00	0.13
366	002178	延华智能	20,468	189,124.32	0.13
367	002577	雷柏科技	6,200	188,108.00	0.12
368	300392	腾信股份	11,000	186,890.00	0.12
369	002527	新时达	13,750	184,387.50	0.12
370	002540	亚太科技	23,400	183,690.00	0.12
371	002378	章源钨业	18,600	182,094.00	0.12
372	002658	雪迪龙	10,549	181,442.80	0.12
373	300348	长亮科技	7,300	181,332.00	0.12
374	002009	天奇股份	12,500	180,875.00	0.12
375	300052	中青宝	7,500	179,250.00	0.12
376	002214	大立科技	16,200	179,010.00	0.12
377	002653	海思科	11,100	173,493.00	0.11
378	002741	光华科技	8,700	169,824.00	0.11
379	300056	三维丝	10,180	169,497.00	0.11
380	002293	罗莱生活	12,550	168,797.50	0.11
381	300307	慈星股份	16,094	168,665.12	0.11
382	300248	新开普	5,600	159,656.00	0.11
383	300074	华平股份	17,079	157,126.80	0.10
384	300205	天喻信息	10,888	156,133.92	0.10

385	300516	久之洋	1,600	155,616.00	0.10
386	002314	南山控股	20,400	155,448.00	0.10
387	002181	粤传媒	19,300	152,084.00	0.10
388	300071	华谊嘉信	15,100	148,886.00	0.10
389	002574	明牌珠宝	12,800	148,096.00	0.10
390	002115	三维通信	13,950	146,893.50	0.10
391	002362	汉王科技	6,500	146,640.00	0.10
392	300458	全志科技	1,600	146,288.00	0.10
393	002233	塔牌集团	15,377	143,774.95	0.10
394	002315	焦点科技	2,197	132,457.13	0.09
395	300145	中金环境	4,800	125,280.00	0.08
396	002189	利达光电	5,700	124,488.00	0.08
397	300484	蓝海华腾	1,600	122,928.00	0.08
398	002678	珠江钢琴	8,200	122,016.00	0.08
399	002191	劲嘉股份	11,200	116,592.00	0.08
400	002232	启明信息	8,720	116,063.20	0.08
401	002801	微光股份	900	115,560.00	0.08
402	002104	恒宝股份	9,600	113,184.00	0.07
403	300155	安居宝	8,900	112,051.00	0.07
404	002716	金贵银业	4,800	111,072.00	0.07
405	002266	浙富控股	19,200	110,592.00	0.07
406	300263	隆华节能	15,000	110,550.00	0.07
407	002051	中工国际	4,800	110,016.00	0.07
408	300314	戴维医疗	4,700	99,922.00	0.07
409	300329	海伦钢琴	6,200	99,820.00	0.07
410	002022	科华生物	4,800	96,000.00	0.06
411	002752	昇兴股份	5,550	95,848.50	0.06
412	002624	完美世界	3,200	95,328.00	0.06
413	300185	通裕重工	30,400	93,936.00	0.06
414	002802	洪汇新材	1,600	91,936.00	0.06
415	002695	煌上煌	3,200	90,592.00	0.06
416	300294	博雅生物	1,600	90,160.00	0.06
417	002399	海普瑞	4,800	87,456.00	0.06
418	300474	景嘉微	1,600	86,192.00	0.06
419	002227	奥特迅	3,540	85,561.80	0.06
420	002375	亚厦股份	8,000	84,640.00	0.06
421	002063	远光软件	6,400	84,096.00	0.06
422	300036	超图软件	4,800	83,520.00	0.06
423	002402	和而泰	8,000	81,920.00	0.05

424	300037	新宙邦	1,600	78,880.00	0.05
425	300506	名家汇	1,600	77,296.00	0.05
426	002707	众信旅游	4,800	74,640.00	0.05
427	300476	胜宏科技	3,200	73,120.00	0.05
428	300292	吴通控股	8,000	69,840.00	0.05
429	300073	当升科技	1,600	68,912.00	0.05
430	002675	东诚药业	4,800	68,640.00	0.05
431	002352	鼎泰新材	1,600	66,464.00	0.04
432	002222	福晶科技	4,800	65,040.00	0.04
433	300221	银禧科技	3,200	63,168.00	0.04
434	002643	万润股份	1,600	58,080.00	0.04
435	300465	高伟达	3,200	57,984.00	0.04
436	300116	坚瑞沃能	3,200	57,920.00	0.04
437	300256	星星科技	4,800	56,880.00	0.04
438	002619	巨龙管业	3,200	55,520.00	0.04
439	002458	益生股份	1,600	55,040.00	0.04
440	002670	国盛金控	1,600	53,760.00	0.04
441	300327	中颖电子	1,600	53,440.00	0.04
442	300512	中亚股份	1,600	53,328.00	0.04
443	002539	云图控股	4,800	53,088.00	0.04
444	300066	三川智慧	8,000	53,040.00	0.04
445	300331	苏大维格	1,600	52,544.00	0.03
446	002190	成飞集成	1,600	51,168.00	0.03
447	002533	金杯电工	4,800	49,344.00	0.03
448	002703	浙江世宝	1,600	49,312.00	0.03
449	002782	可立克	1,600	43,696.00	0.03
450	300048	合康新能	4,800	39,456.00	0.03
451	300432	富临精工	1,600	39,040.00	0.03
452	002446	盛路通信	1,600	35,872.00	0.02
453	002786	银宝山新	1,600	33,296.00	0.02
454	002590	万安科技	1,600	32,512.00	0.02

### 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	002297	博云新材	22,050	288,634.50	0.19

## 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	300408	三环集团	821,514.00	0.48
2	300134	大富科技	741,783.00	0.43
3	300296	利亚德	697,192.13	0.40
4	300266	兴源环境	668,618.85	0.39
5	002709	天赐材料	629,451.00	0.37
6	002343	慈文传媒	619,786.50	0.36
7	002092	中泰化学	596,454.00	0.35
8	300078	思创医惠	556,318.00	0.32
9	002250	联化科技	524,530.13	0.30
10	002073	软控股份	520,332.00	0.30
11	002501	利源精制	520,232.00	0.30
12	300333	兆日科技	507,079.00	0.29
13	002011	盾安环境	506,713.00	0.29
14	002074	国轩高科	505,375.50	0.29
15	300136	信维通信	502,382.00	0.29
16	002075	沙钢股份	486,547.00	0.28
17	002048	宁波华翔	486,123.00	0.28
18	300496	中科创达	485,903.00	0.28
19	300098	高新兴	472,699.85	0.27
20	002517	恺英网络	469,898.00	0.27

### 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	002466	天齐锂业	1,996,828.80	1.16
2	002460	赣锋锂业	1,194,521.20	0.69
3	002176	江特电机	1,101,471.20	0.64
4	002273	水晶光电	903,588.87	0.52

5	002681	奋达科技	696,960.00	0.40
6	002489	浙江永强	632,498.69	0.37
7	002439	启明星辰	560,988.88	0.33
8	300028	金亚科技	547,648.50	0.32
9	002276	万马股份	527,997.22	0.31
10	300208	恒顺众昇	506,391.00	0.29
11	300185	通裕重工	501,416.64	0.29
12	300244	迪安诊断	492,544.00	0.29
13	002179	中航光电	438,856.61	0.25
14	300408	三环集团	405,537.00	0.24
15	002407	多氟多	399,044.64	0.23
16	002018	华信国际	379,526.00	0.22
17	002470	金正大	370,599.54	0.22
18	002424	贵州百灵	365,448.60	0.21
19	002342	巨力索具	352,030.00	0.20
20	002657	中科金财	339,779.00	0.20

#### 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	54,881,874.27
卖出股票收入（成交）总额	54,031,575.84

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	691.85
2	应收证券清算款	334,595.02
3	应收股利	-
4	应收利息	251.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	335,538.34

### 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	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	-------	----------

				净值比例 (%)	
1	300088	长信科技	1,050,700.00	0.70	重大事项停牌
2	002075	沙钢股份	830,180.00	0.55	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	002297	博云新材	288,634.50	0.19	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
373	202,577.12	71,711,808.00	94.91%	3,849,456.00	5.09%

#### 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	71,684,808.00	94.87%

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	何凤珍	466,899.00	0.62%
2	马学清	145,026.00	0.19%
3	张凡	140,000.00	0.19%
4	徐隽婵	103,270.00	0.14%
5	谭惠玲	100,009.00	0.13%
6	薛芸	100,000.00	0.13%

7	王传宁	88,510.00	0.12%
8	许爱贞	80,000.00	0.11%
9	徐立群	66,500.00	0.09%
10	孔繁益	58,000.00	0.08%
11	中国工商银行一中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	71,684,808.00	94.87%

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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

## § 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	67,561,264.00
本报告期基金总申购份额	40,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	32,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	75,561,264.00

## § 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

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。

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。

(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 5 年为本基金提供审计服务。

### 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

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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	3	60,517,608.73	55.59%	42,366.97	55.59%	新增 2 个
东方证券股份有限公司	1	48,352,401.98	44.41%	33,851.56	44.41%	新增
北京高华证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融 股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 1 个
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
中泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集团 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
德邦证券有限 责任公司	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	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

有限责任公司						
--------	--	--	--	--	--	--

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。

### 11.7.2 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	46.74%
东方证券股份有限公司	68,688.90	53.26%

### 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

## § 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  
2017 年 3 月 29 日