

中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 26 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 2017 年 8 月 23 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
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.....	65
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.....	65
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.....	65
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.....	65
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
7.12 投资组合报告附注.....	65
§8 基金份额持有人信息.....	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	67
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
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.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	69
§10 重大事件揭示.....	70
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	75

§11 影响投资者决策的其他重要信息	75
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	错误!未定义书签。
§12 备查文件目录	76
12.1 备查文件目录.....	76
12.2 存放地点.....	76
12.3 查阅方式.....	76

§ 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	74,561,264.00 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	2012-05-11

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

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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-4,808,623.89
本期利润	-10,155,026.19
加权平均基金份额本期利润	-0.1370
本期加权平均净值利润率	-7.14%
本期基金份额净值增长率	-7.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	53,449,242.48
期末可供分配基金份额利润	0.7169
期末基金资产净值	138,365,836.41
期末基金份额净值	1.8557
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	85.57%

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

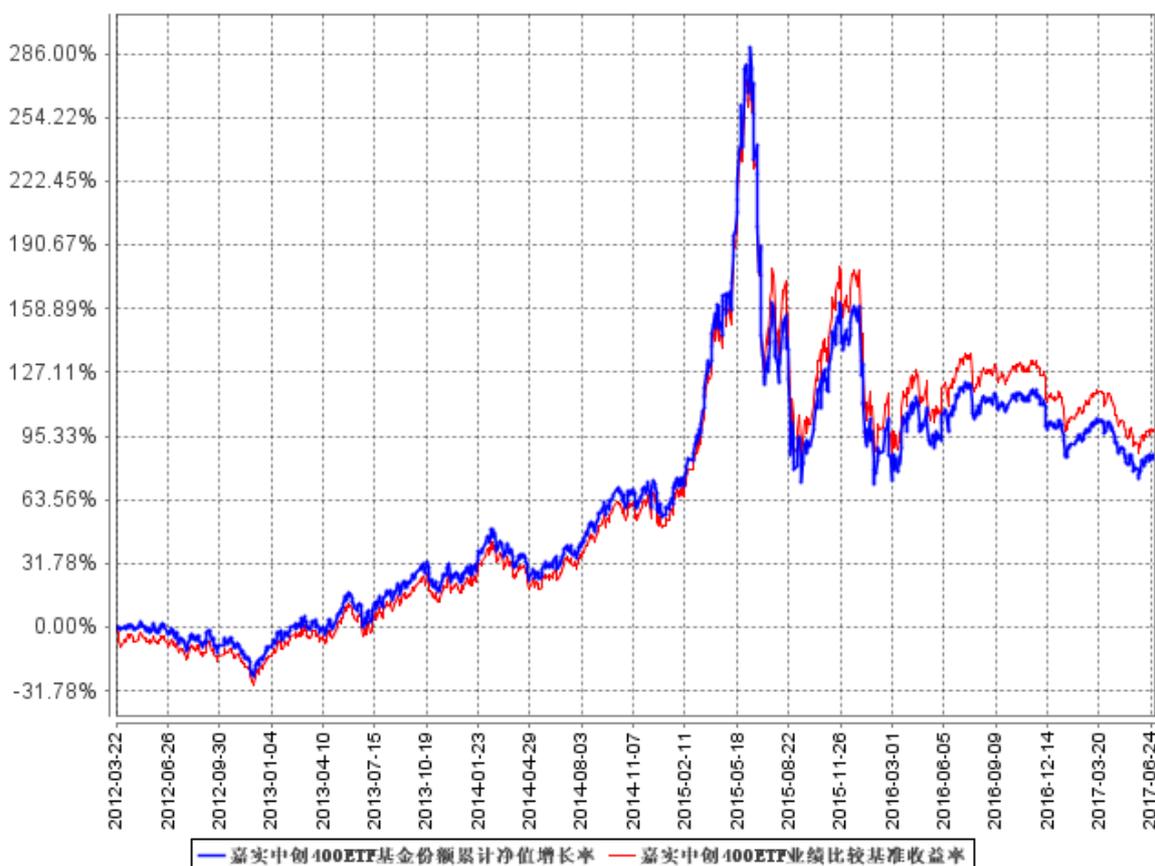
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.75%	1.00%	3.76%	1.00%	-0.01%	0.00%
过去三个月	-6.07%	0.98%	-6.15%	0.99%	0.08%	-0.01%

过去六个月	-7.12%	0.95%	-6.94%	0.96%	-0.18%	-0.01%
过去一年	-13.94%	0.98%	-13.48%	0.99%	-0.46%	-0.01%
过去三年	35.82%	2.10%	51.80%	2.14%	-15.98%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	85.57%	1.86%	98.74%	1.90%	-13.17%	-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2017年6月30日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期，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。

§ 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 2017 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、129 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实元和、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 300ETF 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）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、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、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 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、嘉实新消费股票基金、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、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债

券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、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、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、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、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实新添华定期混合、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、嘉实原油 (QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳康纯债债券、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接。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 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实创业板 ETF 基金经理	2016 年 3 月 24 日	-	12 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、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实中关村 A 股 ETF 基金经理	2016 年 3 月 24 日	-	8 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。
-----	---	-----------------	---	-----	--

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；（3）本基金基金经理刘珈吟女士因个人身体原因休假超过 30 日，在其休假期间，本基金暂由我公司基金经理何如女士、陈正宪先生代为履行基金经理职责。该事项已于 2017 年 4 月 28 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。 本基金基金经理刘珈吟女士已结束休假，自 2017 年 8 月 10 日起恢复履行基金经理职务。该事项已于 2017 年 8 月 10 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。

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 6 次，均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 0.02%，年化跟踪误差为 0.26%。符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.8557 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.12%，业绩比较基准收益率为-6.94%。

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，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。

4.7 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 2017 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,084,322.86	1,370,651.76
结算备付金		4,604.57	14,578.13
存出保证金		1,049.51	691.85
交易性金融资产	6.4.7.2	137,722,363.49	149,625,089.55
其中：股票投资		137,722,363.49	149,625,089.55
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		-	334,595.02
应收利息	6.4.7.5	185.75	251.47
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		138,812,526.18	151,345,857.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		97,081.09	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		56,109.19	65,325.30
应付托管费		11,221.89	13,065.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	23,386.47	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	6.4.7.8	258,891.13	293,201.35
负债合计		446,689.77	382,465.21
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	74,561,264.00	75,561,264.00
未分配利润	6.4.7.10	63,804,572.41	75,402,128.57
所有者权益合计		138,365,836.41	150,963,392.57
负债和所有者权益总计		138,812,526.18	151,345,857.78

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.8557 元，基金份额总额 74,561,264.00 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 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
		2017 年 1 月 1 日至	2016 年 1 月 1 日至 2016

		2017年6月30日	年6月30日
一、收入		-9,359,777.94	-23,404,382.23
1.利息收入		4,032.32	6,993.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,029.82	6,977.13
债券利息收入		2.50	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（损失以“-”填列）		-4,017,460.23	-852,137.76
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,557,347.89	-1,441,810.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,199.95	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	536,687.71	579,701.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,346,402.30	-22,552,251.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	52.27	-6,986.31
减：二、费用		795,248.25	840,101.96
1. 管理人报酬		352,555.13	385,403.67
2. 托管费		70,511.07	77,080.67
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	88,116.92	93,194.04
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	284,065.13	284,423.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,155,026.19	-24,244,484.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,155,026.19	-24,244,484.19

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	75,561,264.00	75,402,128.57	150,963,392.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,155,026.19	-10,155,026.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,000,000.00	-1,442,529.97	-2,442,529.97
其中：1. 基金申购款	7,000,000.00	6,161,144.88	13,161,144.88
2. 基金赎回款	-8,000,000.00	-7,603,674.85	-15,603,674.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以	-	-	-

“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	74,561,264.00	63,804,572.41	138,365,836.41
项目	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	67,561,264.00	104,653,673.48	172,214,937.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-24,244,484.19	-24,244,484.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	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(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	78,561,264.00	90,847,326.85	169,408,590.85

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
基金管理人负责人

 王红
主管会计工作负责人

 张公允
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[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。

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
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	1,084,322.86
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,084,322.86

注：定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	155,919,926.92	137,722,363.49	-18,197,563.43
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	155,919,926.92	137,722,363.49	-18,197,563.43

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2017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（2017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（2017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 2017年6月30日
应收活期存款利息	183.41
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	1.89
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	0.45
合计	185.75

6.4.7.6 其他资产

本期末（2017 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 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	23,386.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	23,386.47

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 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	183,891.13
应付指数使用费	75,000.00
其他	-
合计	258,891.13

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	75,561,264.00	75,561,264.00
本期申购	7,000,000.00	7,000,000.00

本期赎回(以“-”号填列)	-8,000,000.00	-8,000,000.00
本期末	74,561,264.00	74,561,264.00

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	59,048,424.92	16,353,703.65	75,402,128.57
本期利润	-4,808,623.89	-5,346,402.30	-10,155,026.19
本期基金份额交易产生的变动数	-790,558.55	-651,971.42	-1,442,529.97
其中：基金申购款	5,174,379.90	986,764.98	6,161,144.88
基金赎回款	-5,964,938.45	-1,638,736.40	-7,603,674.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,449,242.48	10,355,329.93	63,804,572.41

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	3,619.42
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	401.76
其他	8.64
合计	4,029.82

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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,123,402.57
股票投资收益——赎回差价收入	-1,433,945.32
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-4,557,347.89

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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	34,047,322.14
减：卖出股票成本总额	37,170,724.71
买卖股票差价收入	-3,123,402.57

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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	15,603,674.85
减：现金支付赎回款总额	1,298,288.85
减：赎回股票成本总额	15,739,331.32
赎回差价收入	-1,433,945.32

6.4.7.12.4 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,202.45
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	19,000.00
减：应收利息总额	2.50
买卖债券差价收入	3,199.95

6.4.7.13 衍生工具收益

本期（2017年1月1日至2017年6月30日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	536,687.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	536,687.71

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-5,346,402.30
——股票投资	-5,346,402.30
——债券投资	-

——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-5,346,402.30

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017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	52.27
其他	-
合计	52.27

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	88,116.92
银行间市场交易费用	-
合计	88,116.92

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	74,385.57
债券托管账户维护费	-
银行划款手续费	174.00
指数使用费	150,000.00
上市年费	29,752.78
红利手续费	-
其他	-
合计	284,065.13

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2017年1月1日至2017年6月30日)及上年度可比期间(2016年1月1日至2016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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	352,555.13	385,403.67
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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	70,511.07	77,080.67

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（2017年1月1日至2017年6月30日）及上年度可比期间（2016年1月1日至2016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（2017年1月1日至2017年6月30日）及上年度可比期间（2016年1月1日至2016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 2017年6月30日		上年度末 2016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	70,623,108.00	94.72%	71,684,808.00	94.87%

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	1,084,322.86	3,619.42	966,795.24	6,128.34

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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 06 月 30 日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2017 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（2017 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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002013	中航机电	2017 年 5 月 12 日	重大事项停牌	10.33	2017 年 8 月 2 日	11.36	52,147	552,343.36	538,678.51	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	重大事项停牌	24.95	2017 年 7 月 4 日	22.46	17,504	415,766.28	436,724.80	-
002070	*ST 众和	2017 年 5 月 2 日	重大事项停牌	10.17	-	-	30,534	465,834.00	310,530.78	-
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	-
002128	露天煤业	2017 年 3 月 17 日	重大事项停牌	8.70	2017 年 8 月 14 日	9.57	36,300	347,203.77	315,810.00	-
002143	印纪传媒	2017 年 4 月 18 日	重大事项停牌	24.93	-	-	10,100	325,538.45	251,793.00	-
002168	深圳惠程	2017 年 1 月 23 日	重大事项停牌	16.99	-	-	46,273	601,041.17	786,178.27	-
002256	兆新	2017 年 6 月	重大事项	4.39	-	-	50,072	273,755.18	219,816.08	-

	股份	月 5 日	项停牌								
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		
002263	大东南	2017 年 4 月 24 日	重大事 项停牌	3.28			86,006	344,760.91	282,099.68		
002358	森源电气	2017 年 5 月 12 日	重大事 项停牌	17.02	2017 年 7 月 12 日	16.68	18,712	348,644.41	318,478.24		
002399	海普瑞	2017 年 4 月 28 日	重大事 项停牌	20.23			20,300	374,743.66	410,669.00		
002418	康盛股份	2017 年 3 月 20 日	重大事 项停牌	9.31	2017 年 7 月 10 日	9.30	32,100	338,516.55	298,851.00		
002447	壹桥股份	2017 年 5 月 2 日	重大事 项停牌	9.00			39,876	401,313.98	358,884.00		
002504	*ST 弘高	2017 年 5 月 2 日	重大事 项停牌	8.10			24,693	235,231.42	200,013.30		
002505	大康农业	2017 年 3 月 13 日	重大事 项停牌	3.50			99,850	405,641.46	349,475.00		
002547	春兴精工	2017 年 2 月 20 日	重大事 项停牌	10.89	2017 年 8 月 18 日	9.80	33,500	390,584.58	364,815.00		
002600	江粉磁材	2017 年 2 月 27 日	重大事 项停牌	11.46	2017 年 8 月 9 日	6.25	29,400	278,518.00	336,924.00		
002619	巨龙管业	2017 年 5 月 24 日	重大事 项停牌	6.37			21,780	207,281.14	138,738.60		
002622	融钰集团	2017 年 4 月 20 日	重大事 项停牌	12.30			39,500	514,021.86	485,850.00		
002625	光启技术	2017 年 4 月 13 日	重大事 项停牌	36.36			7,600	339,888.11	276,336.00		
002638	勤上股份	2017 年 4 月 26 日	重大事 项停牌	8.14			43,600	339,075.11	354,904.00		

002642	荣之联	2017年4月10日	重大事件停牌	25.06	2017年7月7日	22.54	16,891	508,100.70	423,288.46	-
002650	加加食品	2017年4月20日	重大事件停牌	5.88	-	-	40,850	268,229.34	240,198.00	-
002675	东诚药业	2017年1月3日	重大事件停牌	14.26	2017年7月17日	12.84	4,800	69,399.00	68,448.00	-
002681	奋达科技	2017年6月22日	重大事件停牌	12.59	2017年7月3日	12.70	20,400	339,011.55	256,836.00	-
002711	欧浦智网	2017年6月26日	重大事件停牌	18.79	2017年7月17日	11.94	16,260	242,513.22	305,525.40	-
300065	海兰信	2016年12月8日	重大事件停牌	25.63	2017年7月6日	23.07	15,600	304,574.85	399,828.00	-
300075	数字政通	2017年6月29日	重大事件停牌	20.94	2017年7月17日	18.86	15,200	434,575.39	318,288.00	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大事件停牌	15.75	2017年8月9日	14.50	66,500	872,998.10	1,047,375.00	-
300098	高新兴	2017年6月22日	重大事件停牌	12.90	2017年7月3日	13.18	27,800	432,436.21	358,620.00	-
300134	大富科技	2017年2月9日	重大事件停牌	23.36	-	-	23,300	696,413.56	544,288.00	-
300145	中金环境	2017年6月28日	重大事件停牌	16.92	-	-	40,780	600,236.24	689,997.60	-
300148	天舟文化	2017年1月25日	重大事件停牌	15.57	2017年8月1日	14.01	26,419	373,037.00	411,343.83	-
300152	科融环境	2017年5月12日	重大事件停牌	7.89	2017年7月12日	7.41	32,600	291,383.47	257,214.00	-
300252	金信诺	2017年4月27日	重大事件停牌	21.65	2017年7月27日	19.49	10,700	348,854.65	231,655.00	-
300267	尔康	2017年5月	重大事件	11.46	-	-	39,900	606,196.97	457,254.00	-

	制药	月 10 日	项停牌							
300271	华宇 软件	2017 年 6 月 22 日	重大事 项停牌	16.59	2017 年 7 月 4 日	16.80	27,767	521,706.08	460,654.53	-
300291	华录 百纳	2017 年 4 月 19 日	重大事 项停牌	20.02	-	-	20,247	568,499.83	405,344.94	-
300364	中文 在线	2017 年 2 月 13 日	重大事 项停牌	37.28	-	-	8,565	501,769.78	319,303.20	-
300367	东方 网力	2016 年 12 月 15 日	重大事 项停牌	20.00	2017 年 7 月 3 日	18.01	24,800	607,729.73	496,000.00	-
300413	快乐 购	2017 年 4 月 5 日	重大事 项停牌	20.29	-	-	12,400	364,475.49	251,596.00	-

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（2017 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（2017 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 2017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	1,084,322.86	-	-	-	1,084,322.86
结算备付金	4,604.57	-	-	-	4,604.57
存出保证金	1,049.51	-	-	-	1,049.51
交易性金融资产	-	-	-	137,722,363.49	137,722,363.49
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	-	-	-	185.75	185.75
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,089,976.94	-	-	137,722,549.24	138,812,526.18
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	-	-	-	97,081.09	97,081.09
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	56,109.19	56,109.19
应付托管费	-	-	-	11,221.89	11,221.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	23,386.47	23,386.47

应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	258,891.13	258,891.13
负债总计	-	-	-	446,689.77	446,689.77
利率敏感度缺口	1,089,976.94	-	-	137,275,859.47	138,365,836.41
上年度末 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
应付税费	-	-	-	-	-
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

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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2016 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(2016 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 2017年6月30日		上年度末 2016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	137,722,363.49	99.53	149,625,089.55	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	137,722,363.49	99.53	149,625,089.55	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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	6,879,524.89	7,490,208.70
	业绩比较基准下降5%	-6,879,524.89	-7,490,208.70

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) (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 121,571,676.27 元，属于第二层次的余额为 16,150,687.22 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 137,857,174.92 元，第二层次 11,767,914.63 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。

(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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。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。

(3) 除公允价值和增值税外，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	137,722,363.49	99.21
	其中：股票	137,722,363.49	99.21
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	1,088,927.43	0.78
7	其他各项资产	1,235.26	0.00
8	合计	138,812,526.18	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	2,487,603.41	1.80
B	采矿业	1,381,679.38	1.00
C	制造业	92,297,360.73	66.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,065,867.90	0.77

E	建筑业	4,390,517.11	3.17
F	批发和零售业	4,375,496.18	3.16
G	交通运输、仓储和邮政业	715,102.96	0.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,144,998.69	15.28
J	金融业	292,560.00	0.21
K	房地产业	1,309,904.34	0.95
L	租赁和商务服务业	1,648,290.48	1.19
M	科学研究和技术服务业	943,689.00	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	1,896,427.20	1.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,360,333.32	0.98
R	文化、体育和娱乐业	2,412,532.79	1.74
S	综合	-	-
	合计	137,722,363.49	99.53

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	002271	东方雨虹	29,942	1,110,848.20	0.80
2	300088	长信科技	66,500	1,047,375.00	0.76
3	300266	兴源环境	32,600	1,001,472.00	0.72

4	300115	长盈精密	30,360	885,904.80	0.64
5	300296	利亚德	44,200	830,960.00	0.60
6	002075	沙钢股份	51,500	830,180.00	0.60
7	002168	深圳惠程	46,273	786,178.27	0.57
8	002050	三花智控	47,644	777,550.08	0.56
9	002280	联络互动	69,300	753,984.00	0.54
10	002311	海大集团	38,900	710,703.00	0.51
11	300015	爱尔眼科	30,162	701,568.12	0.51
12	002185	华天科技	96,896	701,527.04	0.51
13	300145	中金环境	40,780	689,997.60	0.50
14	300142	沃森生物	55,040	680,294.40	0.49
15	002366	台海核电	14,300	670,813.00	0.48
16	300159	新研股份	50,200	664,648.00	0.48
17	300182	捷成股份	69,414	663,597.84	0.48
18	300197	铁汉生态	48,172	639,724.16	0.46
19	300355	蒙草生态	59,380	637,741.20	0.46
20	002217	合力泰	64,200	634,296.00	0.46
21	002583	海能达	38,190	614,477.10	0.44
22	002174	游族网络	19,088	606,234.88	0.44
23	002384	东山精密	23,900	590,330.00	0.43
24	002051	中工国际	28,240	585,415.20	0.42
25	300166	东方国信	43,056	578,242.08	0.42
26	002138	顺络电子	31,094	577,726.52	0.42
27	002410	广联达	30,000	564,000.00	0.41
28	002019	亿帆医药	33,050	551,274.00	0.40
29	002640	跨境通	25,900	550,375.00	0.40
30	300134	大富科技	23,300	544,288.00	0.39
31	002131	利欧股份	163,959	539,425.11	0.39

32	002491	通鼎互联	40,100	538,944.00	0.39
33	002013	中航机电	52,147	538,678.51	0.39
34	002244	滨江集团	77,500	536,300.00	0.39
35	002343	慈文传媒	14,100	533,826.00	0.39
36	002714	牧原股份	19,600	533,512.00	0.39
37	002635	安洁科技	14,550	527,001.00	0.38
38	002221	东华能源	47,476	517,963.16	0.37
39	300287	飞利信	56,100	514,998.00	0.37
40	002408	齐翔腾达	46,371	513,790.68	0.37
41	300324	旋极信息	28,100	512,544.00	0.37
42	002078	太阳纸业	69,704	512,324.40	0.37
43	002373	千方科技	37,400	510,136.00	0.37
44	300122	智飞生物	26,600	508,326.00	0.37
45	002555	三七互娱	19,860	507,820.20	0.37
46	002444	巨星科技	32,400	504,792.00	0.36
47	002624	完美世界	14,600	500,780.00	0.36
48	002431	棕榈股份	45,353	499,790.06	0.36
49	002250	联化科技	34,700	496,210.00	0.36
50	300367	东方网力	24,800	496,000.00	0.36
51	300203	聚光科技	17,600	494,912.00	0.36
52	300146	汤臣倍健	36,000	494,640.00	0.36
53	002048	宁波华翔	23,600	492,296.00	0.36
54	002622	融钰集团	39,500	485,850.00	0.35
55	002191	劲嘉股份	51,500	482,040.00	0.35
56	002028	思源电气	30,060	479,156.40	0.35
57	002501	利源精制	42,100	478,677.00	0.35
58	002665	首航节能	65,650	472,680.00	0.34
59	002589	瑞康医药	30,360	467,544.00	0.34

60	300271	华宇软件	27,767	460,654.53	0.33
61	002462	嘉事堂	11,700	459,693.00	0.33
62	300267	尔康制药	39,900	457,254.00	0.33
63	300090	盛运环保	48,280	457,211.60	0.33
64	300274	阳光电源	41,140	456,242.60	0.33
65	002389	南洋科技	21,582	454,516.92	0.33
66	002354	天神娱乐	20,840	448,060.00	0.32
67	002497	雅化集团	45,978	445,986.60	0.32
68	002595	豪迈科技	19,940	443,266.20	0.32
69	300207	欣旺达	37,476	441,842.04	0.32
70	002544	杰赛科技	19,284	439,675.20	0.32
71	002025	航天电器	17,504	436,724.80	0.32
72	002477	雏鹰农牧	98,487	436,297.41	0.32
73	002035	华帝股份	18,000	435,600.00	0.31
74	002002	鸿达兴业	55,415	433,899.45	0.31
75	300026	红日药业	91,900	432,849.00	0.31
76	300068	南都电源	25,675	432,367.00	0.31
77	300137	先河环保	17,900	426,020.00	0.31
78	300257	开山股份	20,200	425,816.00	0.31
79	002262	恩华药业	28,053	424,441.89	0.31
80	002642	荣之联	16,891	423,288.46	0.31
81	300001	特锐德	25,174	421,916.24	0.30
82	002522	浙江众成	25,700	420,195.00	0.30
83	002517	恺英网络	11,900	418,761.00	0.30
84	002266	浙富控股	85,700	418,216.00	0.30
85	002022	科华生物	24,000	416,880.00	0.30
86	002411	必康股份	14,379	415,840.68	0.30
87	300347	泰格医药	17,106	413,965.20	0.30

88	300083	劲胜精密	44,800	413,952.00	0.30
89	002570	贝因美	30,400	413,440.00	0.30
90	002043	兔宝宝	29,800	412,432.00	0.30
91	300148	天舟文化	26,419	411,343.83	0.30
92	002281	光迅科技	18,512	411,336.64	0.30
93	002399	海普瑞	20,300	410,669.00	0.30
94	002603	以岭药业	23,500	410,310.00	0.30
95	002630	华西能源	35,260	408,663.40	0.30
96	300199	翰宇药业	26,600	408,044.00	0.29
97	300294	博雅生物	9,850	406,214.00	0.29
98	300291	华录百纳	20,247	405,344.94	0.29
99	002261	拓维信息	34,400	402,824.00	0.29
100	002602	世纪华通	11,100	402,486.00	0.29
101	002672	东江环保	23,775	401,559.75	0.29
102	002643	万润股份	27,150	400,734.00	0.29
103	300020	银江股份	28,921	400,266.64	0.29
104	300065	海兰信	15,600	399,828.00	0.29
105	002368	太极股份	14,408	398,957.52	0.29
106	300009	安科生物	24,301	398,779.41	0.29
107	002390	信邦制药	45,500	396,305.00	0.29
108	002285	世联行	49,267	395,121.34	0.29
109	002104	恒宝股份	42,000	394,380.00	0.29
110	002249	大洋电机	59,788	393,405.04	0.28
111	002155	湖南黄金	41,100	393,327.00	0.28
112	002601	龙蟠佰利	24,000	393,120.00	0.28
113	002421	达实智能	63,780	390,333.60	0.28
114	002117	东港股份	15,056	389,649.28	0.28
115	002468	申通快递	15,300	388,773.00	0.28

116	002032	苏泊尔	9,410	386,280.50	0.28
117	002440	闰土股份	25,292	385,955.92	0.28
118	002018	华信国际	56,288	385,572.80	0.28
119	300136	信维通信	9,600	384,192.00	0.28
120	002434	万里扬	24,000	382,080.00	0.28
121	002493	荣盛石化	39,100	381,616.00	0.28
122	002268	卫士通	22,591	379,980.62	0.27
123	002036	联创电子	22,900	377,850.00	0.27
124	002317	众生药业	30,400	377,568.00	0.27
125	002608	江苏国信	30,000	374,700.00	0.27
126	002023	海特高新	36,280	372,595.60	0.27
127	002299	圣农发展	25,000	371,750.00	0.27
128	002047	宝鹰股份	42,900	370,656.00	0.27
129	002396	星网锐捷	18,993	367,514.55	0.27
130	300185	通裕重工	140,700	367,227.00	0.27
131	300463	迈克生物	14,400	367,200.00	0.27
132	300216	千山药机	15,000	366,750.00	0.27
133	300118	东方日升	26,048	365,974.40	0.26
134	002512	达华智能	22,650	365,797.50	0.26
135	002547	春兴精工	33,500	364,815.00	0.26
136	002716	金贵银业	19,000	364,610.00	0.26
137	300053	欧比特	27,028	363,526.60	0.26
138	002308	威创股份	27,743	362,046.15	0.26
139	300284	苏文科	18,300	360,144.00	0.26
140	300054	鼎龙股份	35,329	359,295.93	0.26
141	002436	兴森科技	57,028	359,276.40	0.26
142	300073	当升科技	14,400	359,136.00	0.26
143	002447	壹桥股份	39,876	358,884.00	0.26

144	002145	中核钛白	59,000	358,720.00	0.26
145	300098	高新兴	27,800	358,620.00	0.26
146	300157	恒泰艾普	36,450	357,939.00	0.26
147	002638	勤上股份	43,600	354,904.00	0.26
148	002449	国星光电	21,400	354,170.00	0.26
149	002375	亚厦股份	39,700	353,727.00	0.26
150	002402	和而泰	35,800	352,988.00	0.26
151	002089	新海宜	51,858	351,078.66	0.25
152	300079	数码视讯	60,000	351,000.00	0.25
153	002505	大康农业	99,850	349,475.00	0.25
154	300343	联创互联	18,000	349,200.00	0.25
155	002542	中化岩土	28,850	348,796.50	0.25
156	300116	坚瑞沃能	32,400	348,300.00	0.25
157	002657	中科金财	12,000	347,880.00	0.25
158	002277	友阿股份	53,900	347,655.00	0.25
159	002326	永太科技	25,000	346,500.00	0.25
160	002151	北斗星通	12,377	345,937.15	0.25
161	002130	沃尔核材	53,660	345,033.80	0.25
162	002056	横店东磁	45,800	343,500.00	0.25
163	002011	盾安环境	30,200	342,770.00	0.25
164	002260	德奥通航	14,800	341,880.00	0.25
165	002055	得润电子	14,972	340,313.56	0.25
166	002376	新北洋	24,797	340,214.84	0.25
167	002581	未名医药	16,600	339,470.00	0.25
168	002668	奥马电器	17,200	338,840.00	0.24
169	002067	景兴纸业	57,631	338,293.97	0.24
170	002479	富春环保	28,401	337,971.90	0.24
171	002325	洪涛股份	46,271	337,778.30	0.24

172	300316	晶盛机电	27,000	337,230.00	0.24
173	002600	江粉磁材	29,400	336,924.00	0.24
174	002123	梦网荣信	30,173	335,222.03	0.24
175	002663	普邦股份	61,554	334,238.22	0.24
176	300352	北信源	57,800	333,506.00	0.24
177	002126	银轮股份	32,934	331,316.04	0.24
178	002437	誉衡药业	45,500	331,240.00	0.24
179	002506	协鑫集成	72,000	330,480.00	0.24
180	002254	泰和新材	24,840	330,372.00	0.24
181	300101	振芯科技	23,548	329,672.00	0.24
182	300010	立思辰	25,279	327,363.05	0.24
183	002664	信质电机	11,400	326,268.00	0.24
184	300496	中科创达	11,500	325,450.00	0.24
185	300078	思创医惠	30,260	324,689.80	0.23
186	002245	澳洋顺昌	35,978	324,521.56	0.23
187	002237	恒邦股份	30,800	323,092.00	0.23
188	300180	华峰超纤	12,000	320,280.00	0.23
189	300364	中文在线	8,565	319,303.20	0.23
190	002358	森源电气	18,712	318,478.24	0.23
191	300075	数字政通	15,200	318,288.00	0.23
192	300310	宜通世纪	24,000	317,280.00	0.23
193	002106	莱宝高科	31,300	317,069.00	0.23
194	002073	软控股份	37,300	316,304.00	0.23
195	002128	露天煤业	36,300	315,810.00	0.23
196	002121	科陆电子	36,573	314,527.80	0.23
197	300012	华测检测	67,500	312,525.00	0.23
198	300450	先导智能	6,000	310,620.00	0.22
199	002070	*ST 众和	30,534	310,530.78	0.22

200	002463	沪电股份	68,154	310,100.70	0.22
201	300096	易联众	22,629	309,564.72	0.22
202	300170	汉得信息	30,000	309,300.00	0.22
203	002097	山河智能	34,691	308,402.99	0.22
204	002503	搜于特	43,854	308,293.62	0.22
205	300036	超图软件	18,800	307,380.00	0.22
206	002031	巨轮智能	98,510	306,366.10	0.22
207	002489	浙江永强	48,000	306,240.00	0.22
208	002711	欧浦智网	16,260	305,525.40	0.22
209	002707	众信旅游	23,200	304,616.00	0.22
210	002276	万马股份	30,000	302,700.00	0.22
211	002341	新纶科技	16,212	302,353.80	0.22
212	002342	巨力索具	30,000	302,100.00	0.22
213	300238	冠昊生物	11,900	301,665.00	0.22
214	002428	云南锗业	28,200	301,176.00	0.22
215	002099	海翔药业	45,072	300,179.52	0.22
216	002418	康盛股份	32,100	298,851.00	0.22
217	300212	易华录	11,797	297,638.31	0.22
218	300332	天壕环境	29,400	296,940.00	0.21
219	002413	雷科防务	26,400	295,680.00	0.21
220	002156	通富微电	29,044	295,667.92	0.21
221	300131	英唐智控	35,100	295,542.00	0.21
222	002482	广田集团	32,763	294,539.37	0.21
223	002094	青岛金王	13,779	293,906.07	0.21
224	300376	易事特	32,400	293,868.00	0.21
225	002303	美盈森	38,000	293,360.00	0.21
226	002210	飞马国际	17,044	292,645.48	0.21
227	002670	国盛金控	18,400	292,560.00	0.21

228	300273	和佳股份	24,000	291,840.00	0.21
229	002429	兆驰股份	94,800	291,036.00	0.21
230	002091	江苏国泰	29,945	285,974.75	0.21
231	002224	三力士	25,700	285,270.00	0.21
232	002041	登海种业	21,500	284,875.00	0.21
233	002313	日海通讯	13,889	284,863.39	0.21
234	002467	二六三	35,956	284,771.52	0.21
235	002263	大东南	86,006	282,099.68	0.20
236	002383	合众思壮	18,000	282,060.00	0.20
237	002005	德豪润达	59,000	281,430.00	0.20
238	002242	九阳股份	14,300	281,281.00	0.20
239	300147	香雪制药	27,366	281,048.82	0.20
240	300297	蓝盾股份	25,652	280,889.40	0.20
241	002474	榕基软件	25,888	280,884.80	0.20
242	002148	北纬通信	26,071	280,784.67	0.20
243	002063	远光软件	26,800	279,256.00	0.20
244	002190	成飞集成	10,400	278,720.00	0.20
245	300377	赢时胜	24,450	278,485.50	0.20
246	300039	上海凯宝	38,287	278,346.49	0.20
247	002222	福晶科技	19,500	278,265.00	0.20
248	002481	双塔食品	41,585	277,371.95	0.20
249	002625	光启技术	7,600	276,336.00	0.20
250	002508	老板电器	6,346	275,924.08	0.20
251	002283	天润曲轴	43,054	275,545.60	0.20
252	002564	天沃科技	30,000	273,900.00	0.20
253	300043	星辉娱乐	33,340	273,721.40	0.20
254	300032	金龙机电	19,590	273,280.50	0.20
255	300336	新文化	17,567	271,585.82	0.20

256	002448	中原内配	26,800	271,484.00	0.20
257	002329	皇氏集团	28,200	271,002.00	0.20
258	002690	美亚光电	14,100	270,438.00	0.20
259	300110	华仁药业	30,100	269,094.00	0.19
260	002433	太安堂	29,073	268,925.25	0.19
261	002284	亚太股份	24,200	268,620.00	0.19
262	300228	富瑞特装	23,840	268,438.40	0.19
263	300222	科大智能	11,800	267,742.00	0.19
264	002302	西部建设	12,000	266,040.00	0.19
265	002167	东方锆业	24,000	263,520.00	0.19
266	002649	博彦科技	23,800	262,514.00	0.19
267	002572	索菲亚	6,400	262,400.00	0.19
268	300011	鼎汉技术	16,400	262,400.00	0.19
269	002597	金禾实业	12,000	262,320.00	0.19
270	002161	远望谷	32,100	260,010.00	0.19
271	002563	森马服饰	30,600	259,488.00	0.19
272	002367	康力电梯	22,134	258,525.12	0.19
273	300183	东软载波	12,614	258,334.72	0.19
274	002443	金洲管道	28,032	257,894.40	0.19
275	002253	川大智胜	10,740	257,760.00	0.19
276	300037	新宙邦	11,200	257,376.00	0.19
277	300152	科融环境	32,600	257,214.00	0.19
278	002681	奋达科技	20,400	256,836.00	0.19
279	300005	探路者	32,466	255,832.08	0.18
280	002502	骅威文化	27,100	254,469.00	0.18
281	300038	梅泰诺	6,000	254,100.00	0.18
282	002180	纳思达	10,475	253,076.00	0.18
283	002318	久立特材	30,928	252,991.04	0.18

284	300226	上海钢联	6,796	252,811.20	0.18
285	002143	印纪传媒	10,100	251,793.00	0.18
286	300413	快乐购	12,400	251,596.00	0.18
287	002102	冠福股份	60,000	250,800.00	0.18
288	300476	胜宏科技	10,600	250,478.00	0.18
289	002371	北方华创	10,468	250,394.56	0.18
290	002157	正邦科技	54,957	250,054.35	0.18
291	002085	万丰奥威	12,773	248,434.85	0.18
292	002052	同洲电子	39,168	248,325.12	0.18
293	300128	锦富技术	29,362	246,640.80	0.18
294	002044	美年健康	14,400	244,800.00	0.18
295	300202	聚龙股份	14,800	244,496.00	0.18
296	002636	金安国纪	14,100	243,507.00	0.18
297	002695	煌上煌	11,400	243,504.00	0.18
298	002251	步步高	19,609	242,955.51	0.18
299	002120	韵达股份	4,700	242,520.00	0.18
300	300269	联建光电	12,100	242,363.00	0.18
301	002215	诺普信	28,565	241,659.90	0.17
302	300292	吴通控股	35,600	241,012.00	0.17
303	300327	中颖电子	7,600	240,920.00	0.17
304	300339	润和软件	19,100	240,660.00	0.17
305	002650	加加食品	40,850	240,198.00	0.17
306	300458	全志科技	9,116	240,115.44	0.17
307	002727	一心堂	13,000	239,200.00	0.17
308	002339	积成电子	17,508	238,809.12	0.17
309	002269	美邦服饰	63,900	238,347.00	0.17
310	002170	芭田股份	31,984	237,641.12	0.17
311	300188	美亚柏科	13,700	236,873.00	0.17

312	002498	汉缆股份	64,700	236,802.00	0.17
313	002095	生意宝	6,820	235,699.20	0.17
314	002445	中南文化	18,300	235,155.00	0.17
315	002476	宝莫股份	29,900	233,220.00	0.17
316	002344	海宁皮城	28,000	232,960.00	0.17
317	300252	金信诺	10,700	231,655.00	0.17
318	300359	全通教育	17,600	230,032.00	0.17
319	300031	宝通科技	12,400	228,036.00	0.16
320	002515	金字火腿	24,000	227,520.00	0.16
321	002773	康弘药业	4,350	227,505.00	0.16
322	002279	久其软件	17,735	222,574.25	0.16
323	300034	钢研高纳	14,076	222,541.56	0.16
324	002588	史丹利	28,760	221,164.40	0.16
325	002256	兆新股份	50,072	219,816.08	0.16
326	002717	岭南园林	8,200	219,760.00	0.16
327	300302	同有科技	12,200	219,722.00	0.16
328	002233	塔牌集团	18,000	219,060.00	0.16
329	002288	超华科技	31,284	218,049.48	0.16
330	300178	腾邦国际	16,980	217,344.00	0.16
331	002699	美盛文化	15,700	216,660.00	0.16
332	002538	司尔特	24,000	215,760.00	0.16
333	300369	绿盟科技	19,299	213,446.94	0.15
334	300304	云意电气	24,000	212,880.00	0.15
335	300288	朗玛信息	7,594	211,492.90	0.15
336	002631	德尔未来	14,300	210,639.00	0.15
337	002721	金一文化	14,100	210,513.00	0.15
338	300432	富临精工	8,800	210,320.00	0.15
339	002414	高德红外	11,486	210,193.80	0.15

340	300156	神雾环保	6,414	210,122.64	0.15
341	300300	汉鼎宇佑	11,500	208,610.00	0.15
342	002203	海亮股份	25,600	208,384.00	0.15
343	002364	中恒电气	15,100	206,719.00	0.15
344	002298	中电鑫龙	19,000	206,530.00	0.15
345	300506	名家汇	7,300	206,079.00	0.15
346	300221	银禧科技	14,800	205,720.00	0.15
347	002821	凯莱英	2,800	204,316.00	0.15
348	300231	银信科技	15,400	203,280.00	0.15
349	300047	天源迪科	16,100	203,021.00	0.15
350	002488	金固股份	17,500	202,475.00	0.15
351	300256	星星科技	19,400	201,760.00	0.15
352	002604	龙力生物	21,643	201,496.33	0.15
353	002504	*ST 弘高	24,693	200,013.30	0.14
354	300379	东方通	9,900	194,040.00	0.14
355	002416	爱施德	17,900	193,141.00	0.14
356	002556	辉隆股份	26,444	192,776.76	0.14
357	002229	鸿博股份	17,200	192,640.00	0.14
358	002314	南山控股	28,700	192,003.00	0.14
359	002355	兴民智通	18,500	189,255.00	0.14
360	300224	正海磁材	20,753	186,777.00	0.13
361	002147	新光圆成	12,000	186,480.00	0.13
362	002539	云图控股	21,300	185,310.00	0.13
363	002568	百润股份	11,100	184,482.00	0.13
364	002092	中泰化学	14,400	182,880.00	0.13
365	002361	神剑股份	24,000	181,440.00	0.13
366	002831	裕同科技	2,400	180,000.00	0.13
367	002751	易尚展示	4,800	177,840.00	0.13

368	300317	珈伟股份	12,000	175,200.00	0.13
369	300191	潜能恒信	6,499	173,003.38	0.13
370	002419	天虹股份	12,000	172,560.00	0.12
371	300368	汇金股份	11,700	168,246.00	0.12
372	002655	共达电声	18,937	160,964.50	0.12
373	300386	飞天诚信	8,980	159,754.20	0.12
374	002561	徐家汇	12,000	158,520.00	0.11
375	002590	万安科技	11,200	156,912.00	0.11
376	002247	帝龙文化	11,923	156,429.76	0.11
377	300353	东土科技	12,000	154,560.00	0.11
378	002458	益生股份	7,400	152,810.00	0.11
379	002577	雷柏科技	6,600	151,602.00	0.11
380	002053	云南能投	12,000	150,600.00	0.11
381	300465	高伟达	14,000	149,380.00	0.11
382	300558	贝达药业	2,500	149,100.00	0.11
383	300008	天海防务	18,000	148,860.00	0.11
384	300474	景嘉微	4,200	148,680.00	0.11
385	300331	苏大维格	6,800	147,220.00	0.11
386	002554	惠博普	24,000	141,600.00	0.10
387	002782	可立克	6,700	140,365.00	0.10
388	002619	巨龙管业	21,780	138,738.60	0.10
389	002703	浙江世宝	5,000	136,950.00	0.10
390	002653	海思科	10,300	134,003.00	0.10
391	300215	电科院	12,000	122,160.00	0.09
392	300516	久之洋	1,900	120,631.00	0.09
393	002651	利君股份	12,000	116,520.00	0.08
394	300299	富春股份	6,000	114,300.00	0.08
395	002639	雪人股份	12,000	109,080.00	0.08

396	002818	富森美	2,700	106,569.00	0.08
397	002786	银宝山新	7,200	104,976.00	0.08
398	300527	华舟应急	6,000	104,280.00	0.08
399	002124	天邦股份	12,000	103,920.00	0.08
400	002287	奇正藏药	2,500	102,775.00	0.07
401	002815	崇达技术	3,100	102,424.00	0.07
402	002791	坚朗五金	4,100	95,243.00	0.07
403	002352	顺丰控股	1,600	85,056.00	0.06
404	002110	三钢闽光	6,000	76,920.00	0.06
405	002675	东诚药业	4,800	68,448.00	0.05
406	002801	微光股份	1,600	65,296.00	0.05
407	002020	京新药业	4,792	56,785.20	0.04
408	002550	千红制药	9,552	56,738.88	0.04
409	002267	陕天然气	6,400	56,256.00	0.04
410	002240	威华股份	4,776	56,118.00	0.04
411	002496	辉丰股份	11,187	55,487.52	0.04
412	002471	中超控股	11,200	54,768.00	0.04
413	002118	紫鑫药业	7,902	53,970.66	0.04
414	300485	赛升药业	1,600	52,448.00	0.04
415	002802	洪汇新材	1,600	51,520.00	0.04
416	002480	新筑股份	6,388	50,656.84	0.04
417	002551	尚荣医疗	3,112	50,196.56	0.04
418	002737	葵花药业	1,600	49,280.00	0.04
419	300016	北陆药业	3,200	48,768.00	0.04
420	300484	蓝海华腾	1,600	48,576.00	0.04
421	002609	捷顺科技	3,200	47,904.00	0.03
422	002079	苏州固锝	6,307	46,482.59	0.03
423	002177	御银股份	7,902	44,883.36	0.03

424	300066	三川智慧	8,000	44,320.00	0.03
425	300245	天玑科技	3,150	43,942.50	0.03
426	002093	国脉科技	4,800	42,240.00	0.03
427	300048	合康新能	8,000	42,000.00	0.03
428	002369	卓翼科技	4,782	41,316.48	0.03
429	300006	莱美药业	6,356	41,186.88	0.03
430	300333	兆日科技	3,200	40,128.00	0.03
431	002197	证通电子	3,172	39,840.32	0.03
432	002309	中利集团	3,184	39,831.84	0.03
433	002446	盛路通信	3,190	38,822.30	0.03
434	300229	拓尔思	3,134	38,767.58	0.03
435	002235	安妮股份	3,150	38,430.00	0.03
436	300004	南风股份	3,104	37,279.04	0.03
437	300171	东富龙	3,156	36,893.64	0.03
438	002432	九安医疗	3,188	36,757.64	0.03
439	002698	博实股份	3,116	36,675.32	0.03
440	002533	金杯电工	4,800	36,288.00	0.03
441	300177	中海达	3,180	36,156.60	0.03
442	300439	美康生物	1,600	34,400.00	0.02
443	300348	长亮科技	1,600	33,920.00	0.02
444	002296	辉煌科技	3,120	33,633.60	0.02
445	300045	华力创通	3,200	32,640.00	0.02
446	300512	中亚股份	1,600	32,448.00	0.02
447	300307	慈星股份	3,194	32,323.28	0.02
448	002378	章源钨业	3,200	28,960.00	0.02
449	300295	三六五网	1,512	28,289.52	0.02
450	002111	威海广泰	1,554	28,174.02	0.02
451	002702	海欣食品	3,190	26,381.30	0.02

452	002741	光华科技	1,600	25,024.00	0.02
453	300392	腾信股份	1,600	24,608.00	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	002044	美年健康	722,006.00	0.48
2	002410	广联达	563,093.91	0.37
3	300146	汤臣倍健	490,035.00	0.32
4	300145	中金环境	482,236.00	0.32
5	002051	中工国际	472,102.00	0.31
6	002191	劲嘉股份	451,572.00	0.30
7	002035	华帝股份	429,011.00	0.28
8	002266	浙富控股	410,580.00	0.27
9	002022	科华生物	410,103.00	0.27
10	002104	恒宝股份	409,497.00	0.27
11	002601	龙鳞佰利	393,546.00	0.26
12	002366	台海核电	393,420.21	0.26
13	002280	联络互动	390,059.00	0.26
14	002434	万里扬	382,342.00	0.25
15	002608	江苏国信	373,423.00	0.25
16	002643	万润股份	362,687.00	0.24
17	002375	亚厦股份	362,522.00	0.24

18	300185	通裕重工	356,323.00	0.24
19	300079	数码视讯	350,726.00	0.23
20	002624	完美世界	348,871.00	0.23

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	300136	信维通信	1,265,130.00	0.84
2	002572	索菲亚	998,481.00	0.66
3	002508	老板电器	952,257.00	0.63
4	002085	万丰奥威	920,630.80	0.61
5	300156	神雾环保	912,846.23	0.60
6	002044	美年健康	895,270.00	0.59
7	300408	三环集团	772,059.00	0.51
8	002092	中泰化学	660,143.00	0.44
9	002407	多氟多	624,389.70	0.41
10	002074	国轩高科	616,935.03	0.41
11	002426	胜利精密	537,208.00	0.36
12	300113	顺网科技	447,756.48	0.30
13	002108	沧州明珠	403,760.40	0.27
14	002071	长城影视	326,956.00	0.22
15	300014	亿纬锂能	314,027.05	0.21
16	002297	博云新材	298,381.50	0.20
17	002610	爱康科技	286,257.00	0.19
18	002697	红旗连锁	284,305.40	0.19
19	002064	华峰氨纶	275,011.00	0.18
20	002709	天赐材料	263,360.00	0.17

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	34,492,381.27
卖出股票收入（成交）总额	34,047,322.14

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	1,049.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	185.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,235.26

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**

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	300088	长信科技	1,047,375.00	0.76	重大事项停牌
2	002075	沙钢股份	830,180.00	0.60	重大事项停牌
3	002168	深圳惠程	786,178.27	0.57	重大事项停牌

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
375	198,830.04	70,650,108.00	94.75%	3,911,156.00	5.25%

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	70,623,108.00	94.72%

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	曹建平	432,900.00	0.58%
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	高峰	96,600.00	0.13%
8	许爱贞	80,000.00	0.11%

9	李细环	78,000.00	0.10%
10	徐立群	66,500.00	0.09%
11	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	70,623,108.00	94.72%

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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、基金投资和研究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	75,561,264.00
本报告期基金总申购份额	7,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	74,561,264.00

§ 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

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

(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	
中国国际金 融股份有限 公司	3	35,428,336.66	51.69%	24,800.59	51.69%	新增 1 个
长江证券股 份有限公司	1	33,111,366.75	48.31%	23,179.00	48.31%	-
安信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
东吴证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	新增 2 个
东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股	5	-	-	-	-	-

份有限公司						
广州证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
华西证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券有	1	-	-	-	-	-

限责任公司						
申万宏源证 券有限公司	2	-	-	-	-	-
天源证券经 纪有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	1	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证	1	-	-	-	-	-

券有限责任 公司						
中信建投证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源西 部证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
天风证券股 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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国国际金融股份有限公司	22,202.45	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	嘉实基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年4月28日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2017/01/01至2017/06/30	69,684,808.00	8,000,000.00	7,061,700.00	70,623,108.00	94.72%

产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准中创 400 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内中创 400 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

北京市建国门北大街 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，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日