

中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 06 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：2018 年 08 月 25 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 2018 年 8 月 22 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
7.7 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	50
7.8 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	50

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末上市基金前十名持有人	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 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	72,561,264.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 11 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中创 400 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95588
传真	(010)65215588	(010)66105799
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	赵学军	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(2018年01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	-7,345,735.93
本期利润	-20,175,770.34
加权平均基金份额本期利润	-0.2918
本期加权平均净值利润率	-17.29%
本期基金份额净值增长率	-16.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配利润	34,644,320.63
期末可供分配基金份额利润	0.4774
期末基金资产净值	107,205,584.63
期末基金份额净值	1.4774
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)
基金份额累计净值增长率	47.74%

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

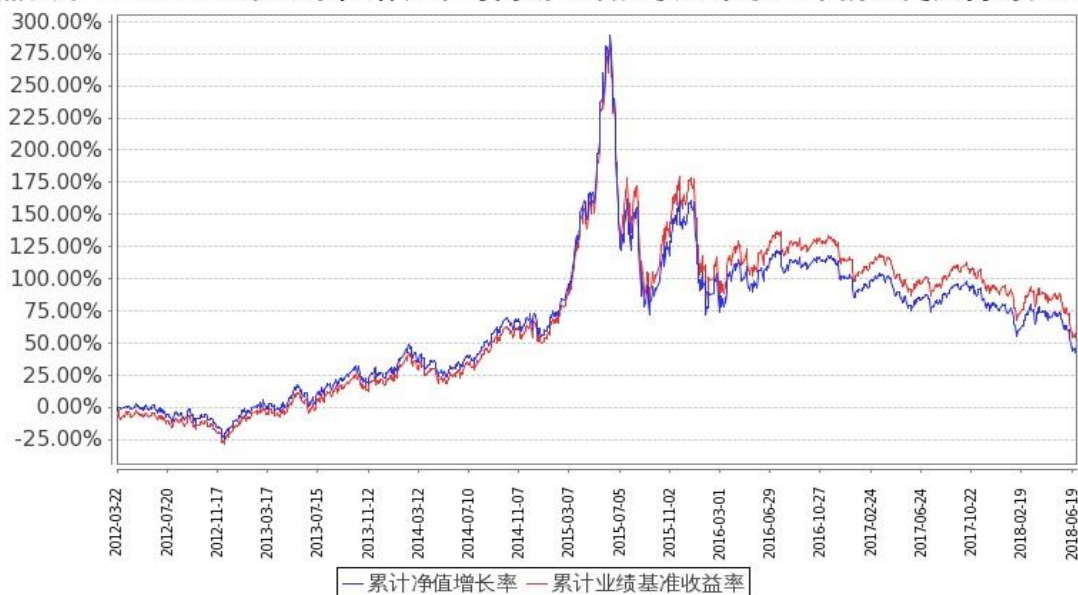
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-9.77%	1.90%	-9.89%	1.91%	0.12%	-0.01%
过去三个月	-16.58%	1.43%	-16.91%	1.44%	0.33%	-0.01%
过去六个月	-16.09%	1.49%	-16.12%	1.50%	0.03%	-0.01%
过去一年	-20.39%	1.26%	-19.89%	1.26%	-0.50%	0.00%
过去三年	-49.00%	1.90%	-44.60%	1.95%	-4.40%	-0.05%
自基金合同生效起至今	47.74%	1.77%	59.21%	1.81%	-11.47%	-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 2018 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、北京怀柔设有分公司。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 2018 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、142 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 300 ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题精选混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国混合 (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 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、嘉实惠泽混合（LOF）、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、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、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、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券。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		
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-		9 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。
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	2016年3月24日-		13 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

	富时中国 A50ETF、嘉实创业板 ETF 基金经理			国台湾籍。
--	----------------------------	--	--	-------

注：（1）任职日期指公司作出决定后公告之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 4 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 0.01%，年化跟踪误差为 0.20%。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 1.4774 元；本报告期基金份额净值增长率为-16.09%，业绩比较基准收益率为-16.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。

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 2018 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,308,106.36	654,803.84
结算备付金		2,411.96	33,606.76
存出保证金		989.87	2,195.83
交易性金融资产	6.4.7.2	106,245,969.54	113,208,810.27
其中：股票投资		106,245,969.54	113,142,410.27
基金投资		-	-
债券投资		-	66,400.00
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		-	138,247.28
应收利息	6.4.7.5	233.32	152.85
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		107,557,711.05	114,037,816.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		74,404.23	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		44,895.49	48,950.30
应付托管费		8,979.09	9,790.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,956.48	21,059.04
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	208,891.13	285,000.00
负债合计		352,126.42	364,799.40
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	72,561,264.00	64,561,264.00
未分配利润	6.4.7.10	34,644,320.63	49,111,753.43
所有者权益合计		107,205,584.63	113,673,017.43
负债和所有者权益总计		107,557,711.05	114,037,816.83

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4774 元，基金份额总额 72,561,264.00 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-19,497,612.25	-9,359,777.94
1. 利息收入		5,177.47	4,032.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,167.30	4,029.82
债券利息收入		10.17	2.50
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）		-6,670,461.71	-4,017,460.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-7,285,321.78	-4,557,347.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	8,729.73	3,199.95

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	606,130.34	536,687.71
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-12,830,034.41	-5,346,402.30
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	-2,293.60	52.27
减：二、费用		678,158.09	795,248.25
1. 管理人报酬		288,614.40	352,555.13
2. 托管费		57,722.87	70,511.07
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	47,748.64	88,116.92
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.05	-
7. 其他费用	6.4.7.19	284,072.13	284,065.13
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-20,175,770.34	-10,155,026.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-20,175,770.34	-10,155,026.19

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	64,561,264.00	49,111,753.43	113,673,017.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,175,770.34	-20,175,770.34
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）	8,000,000.00	5,708,337.54	13,708,337.54

其中：1. 基金申购款	14,000,000.00	9,449,461.28	23,449,461.28
2. 基金赎回款	-6,000,000.00	-3,741,123.74	-9,741,123.74
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）	72,561,264.00	34,644,320.63	107,205,584.63
项目	上年度可比期间 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

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：

经雷

王红

张公允

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中创 400 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]13 号《关于核准中创 400 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资

基金法》和《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 286,543,155.00 元（含募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 066 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 286,561,264.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,109.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的标的指数及业绩比较基准为：中创 400 指数。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以

及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	1,308,106.36
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月及以上	-
其他存款	-
合计	1,308,106.36

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 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	134,487,484.68	106,245,969.54	-28,241,515.14
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	134,487,484.68	106,245,969.54	-28,241,515.14

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（2018 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（2018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（2018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 2018年6月30日
应收活期存款利息	231.97
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	0.99
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	0.36
合计	233.32

6.4.7.6 其他资产

本期末（2018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 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	14,956.48
银行间市场应付交易费用	-
合计	14,956.48

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018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	133,891.13
应付指数使用费	75,000.00
其他	-
合计	208,891.13

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	64,561,264.00	64,561,264.00
本期申购	14,000,000.00	14,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-6,000,000.00	-6,000,000.00
本期末	72,561,264.00	72,561,264.00

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	38,271,854.03	10,839,899.40	49,111,753.43
本期利润	-7,345,735.93	-12,830,034.41	-20,175,770.34
本期基金份额交易产生的变动数	4,383,530.55	1,324,806.99	5,708,337.54
其中：基金申购款	7,785,774.40	1,663,686.88	9,449,461.28
基金赎回款	-3,402,243.85	-338,879.89	-3,741,123.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,309,648.65	-665,328.02	34,644,320.63

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
	活期存款利息收入
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	367.38
其他	14.33
合计	5,167.30

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 2018年1月1日至2018年6月30日
	股票投资收益——买卖股票差价收入
股票投资收益——赎回差价收入	-1,933,771.89
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-7,285,321.78

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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	18,391,566.32
减：卖出股票成本总额	23,743,116.21
买卖股票差价收入	-5,351,549.89

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 2018年1月1日至2018年6月30日
赎回基金份额对价总额	9,741,123.74
减：现金支付赎回款总额	923,895.74
减：赎回股票成本总额	10,750,999.89
赎回差价收入	-1,933,771.89

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	84,146.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	75,400.00
减：应收利息总额	16.27
买卖债券差价收入	8,729.73

6.4.7.14 衍生工具收益

本期（2018年1月1日至2018年6月30日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	606,130.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	606,130.34

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-12,830,034.41
股票投资	-12,830,034.41

债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值 税	-
合计	-12,830,034.41

6.4.7.17 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	-
基金转出费收入	-
替代损益	-2,293.60
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
其他	-
合计	-2,293.60

6.4.7.18 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	47,748.64
银行间市场交易费用	-
合计	47,748.64

6.4.7.19 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	74,385.57
银行划款手续费	181.00
上市年费	29,752.78
指数使用费	150,000.00
合计	284,072.13

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（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2017 年 1 月 1 日至 2017 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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	288,614.40	352,555.13
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
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	57,722.87	70,511.07

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(2018年1月1日至2018年6月30日)及上年度可比期间(2017年1月1日至2017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(2018年1月1日至2018年6月30日)及上年度可比期间(2017年1月1日至2017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 2018年6月30日		上年度末 2017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	68,623,108.00	94.57	60,623,108.00	93.90

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国工商银行股份有限公司_活期	1,308,106.36	4,785.59	1,084,322.86	3,619.42

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,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(2018年1月1日至2018年6月30日)及上年度可比期间(2017年1月1日至2017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（2018年1月1日至2018年6月30日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2018年06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（2018年6月30日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日 期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
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	-
300146	汤臣倍健	2018年 1月31 日	重大事 项停牌	16.60	2018年 7月31 日	16.50	38,000	532,514.95	630,800.00	-
300266	兴源环境	2018年 2月5 日	重大事 项停牌	19.99	2018年 7月2日	17.99	28,300	705,199.95	565,717.00	-
002602	世纪华通	2018年 6月12 日	重大事 项停牌	32.50	-	-	15,900	464,391.53	516,750.00	-
002408	齐翔腾达	2018年 6月19 日	重大事 项停牌	12.28	-	-	41,471	400,665.07	509,263.88	-
002359	北讯集团	2018年 5月21 日	重大事 项停牌	19.58	2018年 8月21 日	17.62	22,100	503,522.83	432,718.00	-
300324	旋极信息	2018年 5月30 日	重大事 项停牌	9.49	-	-	44,707	490,271.34	424,269.43	-
002147	新光圆成	2018年 1月18 日	重大事 项停牌	14.76	-	-	27,270	343,296.43	402,505.20	-
002610	爱康科技	2018年 6月5 日	重大事 项停牌	2.10	-	-	190,700	506,404.44	400,470.00	-
002051	中工国际	2018年 4月4 日	重大事 项停牌	15.27	-	-	24,740	483,856.93	377,779.80	-
300197	铁汉生态	2018年 5月28	重大事 项停牌	5.37	-	-	65,508	502,057.13	351,777.96	-

		日									
300090	盛运环保	2018年6月4日	重大事项停牌	8.32	2018年7月2日	7.49	41,580	414,472.33	345,945.60		-
002411	必康股份	2018年6月19日	重大事项停牌	28.34	-	-	12,079	267,347.61	342,318.86		-
002665	首航节能	2018年5月29日	重大事项停牌	5.80	-	-	57,550	483,925.15	333,790.00		-
002630	华西能源	2018年6月19日	重大事项停牌	6.54	-	-	50,456	364,786.74	329,982.24		-
002210	飞马国际	2018年3月26日	重大事项停牌	12.33	2018年8月13日	11.07	26,555	289,226.31	327,423.15		-
002699	美盛文化	2018年2月5日	重大事项停牌	18.76	2018年7月2日	16.88	15,900	287,556.46	298,284.00		-
002431	棕榈股份	2018年5月30日	重大事项停牌	6.71	-	-	42,853	426,324.85	287,543.63		-
002668	奥马电器	2018年6月15日	重大事项停牌	20.10	-	-	14,200	306,824.80	285,420.00		-
002716	金贵银业	2018年5月3日	重大事项停牌	16.84	-	-	16,800	355,921.39	282,912.00		-
002089	新海宜	2018年4月20日	重大事项停牌	6.05	2018年7月20日	5.45	45,158	349,462.80	273,205.90		-
002477	雏鹰农牧	2018年6月14日	重大事项停牌	3.31	-	-	82,487	410,949.87	273,031.97		-
002102	冠福股份	2018年6月1日	重大事项停牌	4.07	-	-	65,000	274,347.67	264,550.00		-
300118	东方日升	2018年5月7日	重大事项停牌	10.80	2018年8月7日	9.63	24,148	333,366.92	260,798.40		-
002437	誉衡药业	2018年6月11日	重大事项停牌	6.20	2018年8月13日	5.57	40,200	322,444.98	249,240.00		-
002005	德豪	2018年	重大事	4.36	2018年	3.92	50,300	280,123.17	219,308.00		-

	润达	1月2日	项停牌		7月2日						
002464	众应互联	2018年2月2日	重大事件停牌	21.19	2018年7月31日	19.07	10,220	206,630.34	216,561.80		-
002436	兴森科技	2018年6月14日	重大事件停牌	4.29	-	-	50,228	312,094.79	215,478.12		-
002263	*ST东南	2018年2月26日	重大事件停牌	2.96	-	-	72,106	274,888.51	213,433.76		-
002512	达华智能	2018年6月19日	重大事件停牌	9.70	-	-	21,950	325,016.32	212,915.00		-
002121	科陆电子	2018年6月7日	重大事件停牌	6.49	2018年8月6日	5.84	32,273	315,481.48	209,451.77		-
002143	印纪传媒	2018年2月2日	重大事件停牌	12.09	2018年7月9日	10.88	16,260	290,786.38	196,583.40		-
300238	冠昊生物	2018年2月2日	重大事件停牌	18.87	2018年7月18日	16.98	10,100	309,347.52	190,587.00		-
002650	加加食品	2018年3月12日	重大事件停牌	4.86	-	-	36,250	236,550.04	176,175.00		-
300131	英唐智控	2018年5月28日	重大事件停牌	5.67	-	-	30,500	296,332.20	172,935.00		-
002011	盾安环境	2018年5月2日	重大事件停牌	6.40	-	-	26,600	302,298.32	170,240.00		-
300343	联创互联	2018年6月19日	重大事件停牌	10.00	-	-	17,000	301,348.15	170,000.00		-
002445	中南文化	2018年6月13日	重大事件停牌	8.44	-	-	19,700	317,058.30	166,268.00		-
300317	珈伟股份	2018年2月5日	重大事件停牌	11.90	2018年7月3日	10.71	13,400	209,414.70	159,460.00		-
002502	骅威文化	2018年6月5日	重大事件停牌	5.82	-	-	25,000	260,501.81	145,500.00		-

300008	天海 防务	2018 年 6 月 19 日	重大事 项停牌	4.81	2018 年 7 月 3 日	5.20	26,900	216,056.27	129,389.00	-
300299	富春 股份	2018 年 6 月 19 日	重大事 项停牌	4.67	2018 年 7 月 17 日	5.14	19,320	180,988.61	90,224.40	-
002239	奥特 佳	2018 年 4 月 2 日	重大事 项停牌	3.62	-	-	43,300	173,714.01	156,746.00	-

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（2018 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（2018 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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于本报告期末，本基金未持有债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末（2018年6月30日）及上年度末（2017年12月31日），本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日

AAA	-	-
AAA 以下	-	66,400.00
未评级	-	-
合计	-	66,400.00

注:1. 本报告期末(2018年6月30日),本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

2. 长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级,并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

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。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿

透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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 2018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	1,308,106.36	-	-	-	1,308,106.36
结算备付金	2,411.96	-	-	-	2,411.96
存出保证金	989.87	-	-	-	989.87
交易性金融资产	-	-	-	106,245,969.54	106,245,969.54
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	-	-	-	233.32	233.32
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,311,508.19	-	-	-106,246,202.86	107,557,711.05
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	-	-	-	74,404.23	74,404.23
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	44,895.49	44,895.49
应付托管费	-	-	-	8,979.09	8,979.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	14,956.48	14,956.48
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	208,891.13	208,891.13
负债总计	-	-	-	352,126.42	352,126.42
利率敏感度缺口	1,311,508.19	-	-	-105,894,076.44	107,205,584.63
上年度末 2017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	654,803.84	-	-	-	654,803.84
结算备付金	33,606.76	-	-	-	33,606.76
存出保证金	2,195.83	-	-	-	2,195.83
交易性金融资产	-	27,400.00	39,000.00	113,142,410.27	113,208,810.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	138,247.28	138,247.28
应收利息	-	-	-	152.85	152.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	690,606.43	27,400.00	39,000.00	113,280,810.40	114,037,816.83
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	-	-	-	48,950.30	48,950.30
应付托管费	-	-	-	9,790.06	9,790.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	21,059.04	21,059.04
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	-	-	-	364,799.40	364,799.40
利率敏感度缺口	690,606.43	27,400.00	39,000.00	112,916,011.00	113,673,017.43

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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2017 年 12 月 31 日：0.06%）。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2017 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 2018年6月30日		上年度末 2017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	106,245,969.54	99.10	113,142,410.27	99.53
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	106,245,969.54	99.10	113,142,410.27	99.53

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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	5,345,270.34	5,648,083.74
	业绩比较基准下降 5%	-5,345,270.34	-5,648,083.74

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 93,594,782.27 元，属于第二层次的余额为 12,651,187.27 元，无属于第三层次的

余额（上年度末：第一层次 105,371,812.63 元，第二层次 7,836,997.64 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) 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	106,245,969.54	98.78
	其中：股票	106,245,969.54	98.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,310,518.32	1.22
8	其他各项资产	1,223.19	0.00
9	合计	107,557,711.05	100.00

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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告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	1,082,431.97	1.01
B	采矿业	808,321.24	0.75
C	制造业	61,742,687.52	57.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	384,235.65	0.36
E	建筑业	2,397,278.98	2.24
F	批发和零售业	3,836,629.89	3.58
G	交通运输、仓储和邮政业	837,101.69	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,207,476.42	16.05
J	金融业	458,154.75	0.43
K	房地产业	1,232,923.29	1.15
L	租赁和商务服务业	1,846,778.85	1.72
M	科学研究和技术服务业	920,019.60	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	816,636.40	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,745,721.11	1.63
R	文化、体育和娱乐业	2,024,793.54	1.89
S	综合	-	-
	合计	97,341,190.90	90.80

7.2.2 报告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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	70,380.00	0.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,006,256.64	6.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,893.00	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	269,335.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	122,417.00	0.11

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	264,670.00	0.25
J	金融业	150,616.00	0.14
K	房地产业	117,546.00	0.11
L	租赁和商务服务业	503,785.00	0.47
M	科学研究和技术服务业	97,280.00	0.09
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	255,600.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	8,904,778.64	8.31

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300347	泰格医药	15,806	977,917.22	0.91
2	002410	广联达	33,400	926,182.00	0.86
3	002075	沙钢股份	51,500	830,180.00	0.77
4	002311	海大集团	34,700	732,170.00	0.68
5	002384	东山精密	29,300	703,200.00	0.66
6	300253	卫宁健康	56,200	696,318.00	0.65
7	002078	太阳纸业	69,704	675,431.76	0.63
8	002589	瑞康医药	48,960	667,814.40	0.62
9	002217	合力泰	79,200	653,400.00	0.61
10	300146	汤臣倍健	38,000	630,800.00	0.59
11	002493	荣盛石化	59,250	611,460.00	0.57
12	300166	东方国信	40,456	595,916.88	0.56
13	002821	凯莱英	6,800	593,164.00	0.55
14	300009	安科生物	31,141	574,240.04	0.54
15	002127	南极电商	61,150	574,198.50	0.54
16	300266	兴源环境	28,300	565,717.00	0.53
17	300450	先导智能	18,671	564,611.04	0.53
18	002035	华帝股份	23,000	561,890.00	0.52
19	002268	卫士通	25,291	552,102.53	0.51
20	002507	涪陵榨菜	21,400	549,552.00	0.51

21	300170	汉得信息	33,700	547,288.00	0.51
22	002221	东华能源	55,376	541,023.52	0.50
23	002262	恩华药业	26,453	529,324.53	0.49
24	002640	跨境通	35,200	528,704.00	0.49
25	002602	世纪华通	15,900	516,750.00	0.48
26	002408	齐翔腾达	41,471	509,263.88	0.48
27	002371	北方华创	9,768	485,176.56	0.45
28	300182	捷成股份	63,614	482,194.12	0.45
29	300015	爱尔眼科	14,241	459,841.89	0.43
30	300271	华宇软件	25,767	455,560.56	0.42
31	002506	协鑫集成	96,700	452,556.00	0.42
32	300073	当升科技	13,100	446,186.00	0.42
33	002138	顺络电子	27,594	441,779.94	0.41
34	002497	雅化集团	41,678	439,286.12	0.41
35	002359	北讯集团	22,100	432,718.00	0.40
36	300413	快乐购	11,400	432,516.00	0.40
37	002373	千方科技	32,900	429,345.00	0.40
38	300558	贝达药业	7,700	428,659.00	0.40
39	002032	苏泊尔	8,310	427,965.00	0.40
40	300324	旋极信息	44,707	424,269.43	0.40
41	002491	通鼎互联	37,800	418,446.00	0.39
42	300316	晶盛机电	30,920	410,926.80	0.38
43	002341	新纶科技	30,824	409,650.96	0.38
44	002280	联络互动	71,600	409,552.00	0.38
45	300010	立思辰	33,279	407,334.96	0.38
46	002353	杰瑞股份	24,900	404,625.00	0.38
47	002147	新光圆成	27,270	402,505.20	0.38
48	002610	爱康科技	190,700	400,470.00	0.37
49	002023	海特高新	31,780	398,521.20	0.37
50	300142	沃森生物	19,940	398,401.20	0.37
51	300012	华测检测	69,300	397,782.00	0.37
52	300287	飞利信	55,300	397,607.00	0.37
53	300203	聚光科技	15,500	396,800.00	0.37
54	002028	思源电气	23,560	395,572.40	0.37
55	002399	海普瑞	17,700	391,878.00	0.37
56	002168	深圳惠程	37,973	390,362.44	0.36
57	002396	星网锐捷	18,993	388,786.71	0.36
58	002174	游族网络	19,488	387,811.20	0.36
59	002440	闰土股份	33,138	387,383.22	0.36
60	002563	森马服饰	26,800	383,240.00	0.36
61	002281	光迅科技	17,912	379,734.40	0.35
62	002366	台海核电	26,500	377,890.00	0.35

63	002051	中工国际	24,740	377,779.80	0.35
64	300188	美亚柏科	20,420	373,686.00	0.35
65	002583	海能达	44,190	368,986.50	0.34
66	002368	太极股份	12,608	366,514.56	0.34
67	002383	合众思壮	22,100	365,755.00	0.34
68	300226	上海钢联	6,096	364,845.60	0.34
69	002372	伟星新材	20,490	362,468.10	0.34
70	002244	滨江集团	69,600	361,920.00	0.34
71	002004	华邦健康	70,500	358,140.00	0.33
72	002376	新北洋	21,597	357,214.38	0.33
73	002701	奥瑞金	65,000	354,900.00	0.33
74	300122	智飞生物	7,700	352,198.00	0.33
75	300197	铁汉生态	65,508	351,777.96	0.33
76	300616	尚品宅配	3,200	348,800.00	0.33
77	300036	超图软件	17,000	346,630.00	0.32
78	300090	盛运环保	41,580	345,945.60	0.32
79	002603	以岭药业	24,700	345,306.00	0.32
80	002358	森源电气	22,912	344,825.60	0.32
81	002597	金禾实业	17,000	344,760.00	0.32
82	002517	恺英网络	47,900	344,401.00	0.32
83	002411	必康股份	12,079	342,318.86	0.32
84	002131	利欧股份	161,927	340,046.70	0.32
85	300463	迈克生物	13,500	336,555.00	0.31
86	002665	首航节能	57,550	333,790.00	0.31
87	300199	翰宇药业	23,300	332,724.00	0.31
88	002191	劲嘉股份	44,500	332,415.00	0.31
89	002831	裕同科技	6,600	330,000.00	0.31
90	002630	华西能源	50,456	329,982.24	0.31
91	002285	世联行	52,567	329,595.09	0.31
92	002343	慈文传媒	17,480	328,099.60	0.31
93	002210	飞马国际	26,555	327,423.15	0.31
94	300496	中科创达	11,100	327,117.00	0.31
95	002152	广电运通	55,500	326,340.00	0.30
96	300367	东方网力	25,900	323,750.00	0.30
97	002595	豪迈科技	18,540	322,410.60	0.30
98	002745	木林森	18,100	321,999.00	0.30
99	300026	红日药业	87,800	320,470.00	0.30
100	300159	新研股份	45,100	319,308.00	0.30
101	300098	高新兴	39,983	319,064.34	0.30
102	002151	北斗星通	12,377	318,088.90	0.30
103	300180	华峰超纤	29,060	314,719.80	0.29
104	002266	浙富控股	82,700	310,125.00	0.29

105	002444	巨星科技	28,100	309,381.00	0.29
106	300244	迪安诊断	16,200	307,962.00	0.29
107	002419	天虹股份	21,000	306,600.00	0.29
108	002317	众生药业	28,800	304,416.00	0.28
109	300377	赢时胜	22,250	302,377.50	0.28
110	002699	美盛文化	15,900	298,284.00	0.28
111	002250	联化科技	33,600	296,352.00	0.28
112	300207	欣旺达	32,876	296,212.76	0.28
113	002025	航天电器	12,804	295,772.40	0.28
114	002690	美亚光电	12,300	293,232.00	0.27
115	300212	易华录	12,376	292,692.40	0.27
116	300101	振芯科技	20,648	291,756.24	0.27
117	002501	利源精制	46,900	290,780.00	0.27
118	002505	大康农业	135,150	289,221.00	0.27
119	002180	纳思达	10,475	287,643.50	0.27
120	002431	棕榈股份	42,853	287,543.63	0.27
121	002128	露天煤业	31,700	287,202.00	0.27
122	300476	胜宏科技	18,580	286,132.00	0.27
123	002668	奥马电器	14,200	285,420.00	0.27
124	300054	鼎龙股份	32,729	285,396.88	0.27
125	300037	新宙邦	10,600	283,974.00	0.26
126	300628	亿联网络	4,300	283,413.00	0.26
127	002716	金贵银业	16,800	282,912.00	0.26
128	300222	科大智能	15,200	281,808.00	0.26
129	002056	横店东磁	40,100	281,101.00	0.26
130	300053	欧比特	24,228	281,044.80	0.26
131	002812	创新股份	5,700	280,041.00	0.26
132	002672	东江环保	21,275	278,489.75	0.26
133	002161	远望谷	28,700	278,103.00	0.26
134	002402	和而泰	33,200	275,560.00	0.26
135	002156	通富微电	25,444	275,558.52	0.26
136	002126	银轮股份	30,534	275,416.68	0.26
137	300145	中金环境	35,080	274,676.40	0.26
138	002449	国星光电	25,770	274,192.80	0.26
139	002089	新海宜	45,158	273,205.90	0.25
140	002477	雏鹰农牧	82,487	273,031.97	0.25
141	002155	湖南黄金	39,900	272,916.00	0.25
142	300257	开山股份	17,800	272,162.00	0.25
143	300459	金科文化	28,100	271,446.00	0.25
144	300294	博雅生物	8,750	271,162.50	0.25
145	300068	南都电源	22,575	270,448.50	0.25
146	002313	日海智能	11,289	270,145.77	0.25

147	002390	信邦制药	36,200	264,984.00	0.25
148	002102	冠福股份	65,000	264,550.00	0.25
149	002299	圣农发展	16,900	261,781.00	0.24
150	002389	南洋科技	19,282	261,078.28	0.24
151	300118	东方日升	24,148	260,798.40	0.24
152	300002	神州泰岳	61,900	258,123.00	0.24
153	002240	威华股份	19,800	257,400.00	0.24
154	002036	联创电子	19,500	255,840.00	0.24
155	002099	海翔药业	49,372	253,278.36	0.24
156	300078	思创医惠	26,560	251,788.80	0.23
157	002120	韵达股份	4,739	251,403.95	0.23
158	300137	先河环保	15,700	250,886.00	0.23
159	002277	友阿股份	54,300	250,323.00	0.23
160	002437	誉衡药业	40,200	249,240.00	0.23
161	002048	宁波华翔	20,200	249,066.00	0.23
162	002022	科华生物	21,000	248,850.00	0.23
163	002670	国盛金控	22,975	247,440.75	0.23
164	002254	泰和新材	21,740	247,401.20	0.23
165	002421	达实智能	60,580	245,349.00	0.23
166	300001	特锐德	21,274	241,672.64	0.23
167	002157	正邦科技	59,157	240,768.99	0.22
168	002123	梦网集团	27,073	240,678.97	0.22
169	300409	道氏技术	6,000	240,660.00	0.22
170	002237	恒邦股份	26,100	238,293.00	0.22
171	002354	天神娱乐	25,540	236,500.40	0.22
172	300297	蓝盾股份	29,052	235,611.72	0.22
173	300323	华灿光电	18,200	235,144.00	0.22
174	300020	银江股份	24,621	234,145.71	0.22
175	300185	通裕重工	128,300	232,223.00	0.22
176	002091	江苏国泰	36,545	232,060.75	0.22
177	300079	数码科技	63,700	231,868.00	0.22
178	002251	步步高	20,309	231,116.42	0.22
179	002664	长鹰信质	9,200	230,920.00	0.22
180	002002	鸿达兴业	49,915	230,108.15	0.21
181	300369	绿盟科技	21,499	230,039.30	0.21
182	002468	申通快递	13,400	229,810.00	0.21
183	002544	杰赛科技	16,684	228,403.96	0.21
184	002249	大洋电机	52,988	228,378.28	0.21
185	002073	软控股份	39,400	226,550.00	0.21
186	002139	拓邦股份	39,750	226,177.50	0.21
187	002463	沪电股份	60,354	225,723.96	0.21
188	002222	福晶科技	17,300	225,592.00	0.21

189	002061	浙江交科	21,500	225,105.00	0.21
190	002095	生意宝	6,220	223,235.80	0.21
191	002717	岭南股份	22,740	223,079.40	0.21
192	002055	得润电子	13,972	222,853.40	0.21
193	300038	梅泰诺	20,860	222,367.60	0.21
194	002047	宝鹰股份	37,900	222,094.00	0.21
195	002242	九阳股份	12,500	221,125.00	0.21
196	002635	安洁科技	12,850	221,020.00	0.21
197	002233	塔牌集团	19,300	220,792.00	0.21
198	300083	劲胜智能	45,800	220,756.00	0.21
199	002675	东诚药业	21,600	220,104.00	0.21
200	002707	众信旅游	22,900	219,840.00	0.21
201	002005	德豪润达	50,300	219,308.00	0.20
202	002464	众应互联	10,220	216,561.80	0.20
203	002436	兴森科技	50,228	215,478.12	0.20
204	300085	银之杰	16,600	215,468.00	0.20
205	300352	北信源	53,300	215,332.00	0.20
206	002130	沃尔核材	49,160	214,337.60	0.20
207	002263	*ST 东南	72,106	213,433.76	0.20
208	002512	达华智能	21,950	212,915.00	0.20
209	002104	恒宝股份	31,200	212,472.00	0.20
210	300178	腾邦国际	15,080	212,024.80	0.20
211	002308	威创股份	25,443	211,176.90	0.20
212	300157	恒泰艾普	32,450	210,925.00	0.20
213	002245	澳洋顺昌	32,578	210,779.66	0.20
214	002839	张家港行	34,600	210,714.00	0.20
215	300353	东土科技	16,400	209,756.00	0.20
216	002121	科陆电子	32,273	209,451.77	0.20
217	002043	兔宝宝	27,300	209,118.00	0.20
218	002434	万里扬	23,700	208,086.00	0.19
219	002303	美盈森	39,400	208,032.00	0.19
220	002657	中科金财	13,100	207,504.00	0.19
221	002429	兆驰股份	83,000	205,840.00	0.19
222	002503	搜于特	58,754	205,639.00	0.19
223	002773	康弘药业	3,950	205,439.50	0.19
224	002841	视源股份	3,820	204,026.20	0.19
225	300039	上海凯宝	34,787	201,764.60	0.19
226	002462	嘉事堂	10,400	201,760.00	0.19
227	002608	江苏国信	29,000	200,100.00	0.19
228	002063	远光软件	23,600	199,656.00	0.19
229	002097	山河智能	30,391	198,757.14	0.19
230	002145	中核钛白	54,000	198,720.00	0.19

231	300088	长信科技	34,200	198,360.00	0.19
232	002067	景兴纸业	50,431	197,689.52	0.18
233	300431	暴风集团	13,000	197,340.00	0.18
234	300327	中颖电子	8,311	197,220.03	0.18
235	002643	万润股份	26,350	196,834.50	0.18
236	002117	东港股份	13,256	196,586.48	0.18
237	002143	印纪传媒	16,260	196,583.40	0.18
238	300618	寒锐钴业	1,520	195,076.80	0.18
239	002428	云南锗业	25,100	193,772.00	0.18
240	002203	海亮股份	23,700	191,970.00	0.18
241	002094	青岛金王	21,244	191,408.44	0.18
242	300339	润和软件	17,600	191,136.00	0.18
243	300238	冠昊生物	10,100	190,587.00	0.18
244	002433	太安堂	25,473	190,538.04	0.18
245	002642	荣之联	20,691	190,150.29	0.18
246	300284	苏交科	23,920	189,685.60	0.18
247	002649	博彦科技	20,700	188,784.00	0.18
248	002489	浙江永强	51,300	186,732.00	0.17
249	002375	亚厦股份	34,400	183,696.00	0.17
250	300075	数字政通	13,600	183,464.00	0.17
251	002474	榕基软件	23,088	183,087.84	0.17
252	300273	和佳股份	26,900	182,382.00	0.17
253	300457	赢合科技	7,900	181,779.00	0.17
254	300364	中文在线	25,723	181,089.92	0.17
255	002447	晨鑫科技	52,114	178,229.88	0.17
256	002467	二六三	32,856	178,079.52	0.17
257	300134	大富科技	19,900	177,906.00	0.17
258	002276	万马股份	30,300	176,952.00	0.17
259	300474	景嘉微	3,800	176,624.00	0.16
260	002650	加加食品	36,250	176,175.00	0.16
261	002510	天汽模	37,000	175,010.00	0.16
262	300065	海兰信	12,400	174,592.00	0.16
263	300183	东软载波	11,314	173,896.18	0.16
264	300131	英唐智控	30,500	172,935.00	0.16
265	300147	香雪制药	23,966	172,794.86	0.16
266	002622	融钰集团	35,400	171,336.00	0.16
267	002564	天沃科技	30,300	171,195.00	0.16
268	002011	盾安环境	26,600	170,240.00	0.16
269	300343	联创互联	17,000	170,000.00	0.16
270	002542	中化岩土	31,650	169,011.00	0.16
271	002482	广田集团	28,163	168,133.11	0.16
272	002681	奋达科技	19,200	166,272.00	0.16

273	002445	中南文化	19,700	166,268.00	0.16
274	002663	普邦股份	55,754	165,589.38	0.15
275	002185	华天科技	29,096	164,101.44	0.15
276	002302	西部建设	15,200	163,704.00	0.15
277	300044	赛为智能	23,140	163,137.00	0.15
278	002619	艾格拉斯	38,680	162,069.20	0.15
279	002106	莱宝高科	27,800	160,128.00	0.15
280	300317	珈伟股份	13,400	159,460.00	0.15
281	300310	宜通世纪	24,900	158,862.00	0.15
282	002365	永安药业	11,050	158,788.50	0.15
283	002110	三钢闽光	9,900	158,697.00	0.15
284	002747	埃斯顿	11,300	157,974.00	0.15
285	002239	奥特佳	43,300	156,746.00	0.15
286	002190	成飞集成	9,100	155,519.00	0.15
287	002167	东方锆业	25,100	154,114.00	0.14
288	002279	久其软件	15,535	153,951.85	0.14
289	002625	光启技术	13,110	153,518.10	0.14
290	300458	全志科技	8,516	152,606.72	0.14
291	300110	华仁药业	31,820	151,145.00	0.14
292	002344	海宁皮城	30,900	150,174.00	0.14
293	002326	永太科技	21,500	149,425.00	0.14
294	300274	阳光电源	16,640	149,260.80	0.14
295	002581	未名医药	14,000	149,100.00	0.14
296	002522	浙江众成	22,800	147,516.00	0.14
297	300292	吴通控股	39,800	145,668.00	0.14
298	002502	骅威文化	25,000	145,500.00	0.14
299	002711	欧浦智网	17,316	145,108.08	0.14
300	002261	拓维信息	31,500	144,900.00	0.14
301	002307	北新路桥	26,220	144,734.40	0.14
302	300096	易联众	17,129	144,226.18	0.13
303	300336	新文化	17,667	143,986.05	0.13
304	002413	雷科防务	26,700	143,913.00	0.13
305	002414	高德红外	10,686	143,619.84	0.13
306	002547	春兴精工	33,000	143,550.00	0.13
307	002229	鸿博股份	16,000	142,400.00	0.13
308	300291	华录百纳	20,147	142,036.35	0.13
309	002479	富春环保	25,101	141,820.65	0.13
310	300224	正海磁材	17,653	139,635.23	0.13
311	300148	天舟文化	30,519	137,335.50	0.13
312	002080	中材科技	16,100	136,850.00	0.13
313	300032	金龙机电	24,390	136,827.90	0.13
314	300288	朗玛信息	8,294	136,353.36	0.13

315	002367	康力电梯	22,834	136,090.64	0.13
316	002867	周大生	4,300	135,407.00	0.13
317	002068	黑猫股份	17,300	135,113.00	0.13
318	002818	富森美	5,100	134,538.00	0.13
319	002182	云海金属	22,000	133,980.00	0.12
320	002247	帝龙文化	16,323	133,848.60	0.12
321	300221	银禧科技	13,400	132,660.00	0.12
322	002342	巨力索具	35,000	132,650.00	0.12
323	002695	煌上煌	9,900	132,462.00	0.12
324	002148	北纬科技	22,771	132,071.80	0.12
325	002498	汉缆股份	59,600	131,716.00	0.12
326	300202	聚龙股份	12,600	131,418.00	0.12
327	300128	锦富技术	33,692	131,398.80	0.12
328	300043	星辉娱乐	32,840	131,360.00	0.12
329	002458	益生股份	7,400	129,500.00	0.12
330	300008	天海防务	26,900	129,389.00	0.12
331	002041	登海种业	18,900	128,898.00	0.12
332	002045	国光电器	18,000	128,700.00	0.12
333	002648	卫星石化	11,600	127,948.00	0.12
334	300116	坚瑞沃能	46,300	127,788.00	0.12
335	300252	金信诺	14,030	127,252.10	0.12
336	002600	领益智造	23,800	123,522.00	0.12
337	300228	富瑞特装	21,240	121,705.20	0.11
338	002418	康盛股份	27,400	115,628.00	0.11
339	300359	全通教育	16,200	115,344.00	0.11
340	002416	爱施德	19,060	111,882.20	0.10
341	300304	云意电气	26,600	111,720.00	0.10
342	300077	国民技术	10,000	111,200.00	0.10
343	300064	豫金刚石	19,900	106,863.00	0.10
344	002175	东方网络	27,800	105,918.00	0.10
345	002636	金安国纪	13,100	105,717.00	0.10
346	002850	科达利	3,600	101,376.00	0.09
347	002314	南山控股	25,100	101,153.00	0.09
348	002158	汉钟精机	11,200	100,576.00	0.09
349	002378	章源钨业	15,000	99,150.00	0.09
350	300386	飞天诚信	8,280	97,455.60	0.09
351	300299	富春股份	19,320	90,224.40	0.08
352	002545	东方铁塔	13,600	80,920.00	0.08
353	002287	奇正藏药	2,500	71,975.00	0.07
354	002215	诺普信	8,965	62,396.40	0.06
355	300031	宝通科技	4,500	61,650.00	0.06
356	002568	百润股份	4,300	58,093.00	0.05

357	002318	久立特材	9,428	56,756.56	0.05
358	002481	双塔食品	12,185	55,076.20	0.05
359	002448	中原内配	7,700	53,669.00	0.05
360	002031	巨轮智能	24,510	53,431.80	0.05
361	002443	金洲管道	7,732	52,268.32	0.05
362	002260	*ST 德奥	11,000	52,140.00	0.05
363	002325	洪涛股份	14,071	52,062.70	0.05
364	002283	天润曲轴	12,654	50,109.84	0.05
365	300506	名家汇	2,400	49,752.00	0.05
366	002052	同洲电子	11,868	49,370.88	0.05
367	002364	中恒电气	5,100	49,368.00	0.05
368	002588	史丹利	8,960	46,412.80	0.04
369	002639	雪人股份	7,000	45,080.00	0.04
370	002224	三力士	7,500	44,700.00	0.04
371	300379	东方通	2,900	44,399.00	0.04
372	002284	亚太股份	7,300	42,340.00	0.04
373	300332	天壕环境	9,100	42,315.00	0.04
374	300302	同有科技	4,100	41,820.00	0.04
375	002392	北京利尔	12,300	41,820.00	0.04
376	002253	川大智胜	2,840	41,208.40	0.04
377	002361	神剑股份	9,800	40,278.00	0.04
378	300021	大禹节水	7,700	39,886.00	0.04
379	300255	常山药业	7,200	38,952.00	0.04
380	002329	皇氏集团	9,000	38,340.00	0.04
381	002305	南国置业	12,500	37,750.00	0.04
382	002515	金字火腿	7,700	37,576.00	0.04
383	002339	积成电子	5,108	37,543.80	0.04
384	300191	潜能恒信	2,099	37,278.24	0.03
385	002782	可立克	2,200	34,716.00	0.03
386	002590	万安科技	4,200	34,440.00	0.03
387	002658	雪迪龙	4,300	33,583.00	0.03
388	002631	德尔未来	4,500	33,300.00	0.03
389	300011	鼎汉技术	5,100	32,538.00	0.03
390	300269	联建光电	4,900	31,997.00	0.03
391	300215	电科院	5,400	31,968.00	0.03
392	002427	*ST 尤夫	4,300	29,369.00	0.03
393	300152	科融环境	9,600	27,840.00	0.03
394	002616	长青集团	5,000	26,650.00	0.02
395	002018	*ST 华信	16,888	24,487.60	0.02
396	300216	千山药机	4,600	24,426.00	0.02
397	002651	利君股份	4,300	22,145.00	0.02
398	300432	富临精工	2,500	21,900.00	0.02

399	002703	浙江世宝	4,250	21,037.50	0.02
400	002604	*ST 龙力	7,543	15,463.15	0.01

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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300601	康泰生物	8,900	552,245.00	0.52
2	002183	怡亚通	50,500	335,825.00	0.31
3	002030	达安基因	19,100	294,522.00	0.27
4	002407	多氟多	19,300	270,586.00	0.25
5	002727	一心堂	8,300	269,335.00	0.25
6	300133	华策影视	24,000	255,600.00	0.24
7	300285	国瓷材料	12,600	251,244.00	0.23
8	002680	长生生物	10,400	231,816.00	0.22
9	002042	华孚时尚	30,589	227,582.16	0.21
10	002511	中顺洁柔	22,900	215,718.00	0.20
11	002709	天赐材料	5,400	208,116.00	0.19
12	002108	沧州明珠	33,800	198,406.00	0.19
13	002596	海南瑞泽	19,100	195,966.00	0.18
14	002537	海联金汇	20,600	194,464.00	0.18
15	300308	中际旭创	3,200	192,128.00	0.18
16	002020	京新药业	16,300	192,014.00	0.18
17	300373	扬杰科技	6,700	191,620.00	0.18
18	300567	精测电子	2,400	191,040.00	0.18
19	002212	南洋股份	15,300	181,917.00	0.17
20	002258	利尔化学	9,200	178,112.00	0.17
21	002292	奥飞娱乐	19,400	173,242.00	0.16
22	002424	贵州百灵	14,800	168,128.00	0.16
23	002400	省广集团	52,000	167,960.00	0.16
24	002916	深南电路	2,600	165,126.00	0.15
25	300529	健帆生物	3,800	162,982.00	0.15
26	300482	万孚生物	2,300	161,000.00	0.15
27	300699	光威复材	3,400	153,680.00	0.14
28	300613	富瀚微	1,100	152,350.00	0.14
29	002807	江阴银行	26,800	150,616.00	0.14
30	002382	蓝帆医疗	7,700	148,610.00	0.14
31	002626	金达威	8,500	147,475.00	0.14
32	300666	江丰电子	2,600	143,338.00	0.13
33	002531	天顺风能	31,300	136,155.00	0.13
34	300349	金卡智能	7,000	134,680.00	0.13
35	002509	天广中茂	45,500	132,405.00	0.12
36	300102	乾照光电	20,178	132,367.68	0.12

37	002737	葵花药业	6,000	129,780.00	0.12
38	002118	紫鑫药业	17,200	122,980.00	0.11
39	002320	海峡股份	6,460	122,417.00	0.11
40	300232	洲明科技	12,160	120,140.80	0.11
41	002016	世荣兆业	7,800	117,546.00	0.11
42	002430	杭氧股份	7,900	113,207.00	0.11
43	300451	创业软件	7,200	112,320.00	0.10
44	300340	科恒股份	2,900	111,940.00	0.10
45	002920	德赛西威	3,700	110,630.00	0.10
46	002079	苏州固锔	16,100	101,269.00	0.09
47	002178	延华智能	15,200	97,280.00	0.09
48	002409	雅克科技	4,100	79,950.00	0.07
49	002321	华英农业	11,500	70,380.00	0.07
50	002901	大博医疗	1,500	54,480.00	0.05
51	002906	华阳集团	2,700	50,490.00	0.05
52	002911	佛燃股份	2,100	46,893.00	0.04
53	300726	宏达电子	1,500	42,600.00	0.04
54	002907	华森制药	1,500	42,105.00	0.04

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	300601	康泰生物	530,884.00	0.47
2	002004	华邦健康	479,515.00	0.42
3	002745	木林森	406,613.00	0.36
4	002110	三钢闽光	364,503.00	0.32
5	002507	涪陵榨菜	362,539.00	0.32
6	002183	怡亚通	334,768.00	0.29
7	300558	贝达药业	301,161.00	0.26
8	002030	达安基因	291,740.00	0.26
9	002407	多氟多	263,604.00	0.23
10	002727	一心堂	258,276.00	0.23
11	300133	华策影视	251,190.00	0.22
12	300285	国瓷材料	249,175.22	0.22
13	002589	瑞康医药	244,801.00	0.22
14	002042	华孚时尚	225,456.27	0.20
15	002680	长生生物	224,163.00	0.20
16	002831	裕同科技	220,602.00	0.19
17	002821	凯莱英	218,194.00	0.19
18	002384	东山精密	211,429.00	0.19
19	002517	恺英网络	210,576.00	0.19

20	002511	中顺洁柔	207,645.00	0.18
----	--------	------	------------	------

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	300015	爱尔眼科	929,488.00	0.82
2	300142	沃森生物	792,556.00	0.70
3	300122	智飞生物	749,345.21	0.66
4	300088	长信科技	410,595.00	0.36
5	002185	华天科技	358,029.00	0.31
6	002110	三钢闽光	319,505.00	0.28
7	300274	阳光电源	297,074.00	0.26
8	002271	东方雨虹	264,384.40	0.23
9	002600	领益智造	254,411.00	0.22
10	002714	牧原股份	251,071.00	0.22
11	300618	寒锐钴业	236,007.60	0.21
12	300077	国民技术	224,072.00	0.20
13	300296	利亚德	190,509.00	0.17
14	002050	三花智控	179,812.32	0.16
15	300355	蒙草生态	161,566.80	0.14
16	002031	巨轮智能	155,116.00	0.14
17	002019	亿帆医药	146,346.50	0.13
18	002504	弘高创意	135,867.50	0.12
19	002443	金洲管道	131,873.00	0.12
20	300115	长盈精密	128,654.80	0.11

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	18,842,448.78
卖出股票收入（成交）总额	18,391,566.32

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 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。

7.8 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。

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	989.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	233.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,223.19

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	002075	沙钢股份	830,180.00	0.77	重大事项停牌
2	300146	汤臣倍健	630,800.00	0.59	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，本基金持有的积极投资股票不存在流通受限情况。

§ 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 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 (%)
371	195,582.92	68,685,208.00	94.66	3,876,056.00	5.34

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	68,623,108.00	94.57

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	马学清	145,026.00	0.20
2	叶振强	103,813.00	0.14
3	徐隽婵	103,270.00	0.14
4	谭惠玲	100,009.00	0.14
5	薛芸	100,000.00	0.14
6	高峰	96,600.00	0.13
7	廖彩伶	95,900.00	0.13
8	周惠强	86,600.00	0.12
9	许爱贞	80,000.00	0.11
10	张凡	64,800.00	0.09
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	68,623,108.00	94.57

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

报告期末，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	64,561,264.00
本报告期基金总申购份额	14,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
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	72,561,264.00

§ 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

2018年3月21日本基金管理人发布公告，经雷先生任公司总经理，公司董事长赵学军先生不再代任公司总经理职务。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券股份有限公司	1	37,210,345.90	100.00%	26,048.47	100.00%	
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
长江证券股份有限公司	3	-	-	-	-	
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	

国金证券股份有 限公司	1	-	-	-	-
国泰君安证券股 份有限公司	2	-	-	-	-
国信证券股份有 限公司	2	-	-	-	-
海通证券股份有 限公司	2	-	-	-	-
华福证券有限责 任公司	1	-	-	-	-
华泰证券股份有 限公司	1	-	-	-	-
民生证券股份有 限公司	1	-	-	-	-
申万宏源证券有 限公司	1	-	-	-	-
天风证券股份有 限公司	2	-	-	-	-
西藏东方财富证 券股份有限公司	2	-	-	-	-
兴业证券股份有 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	-	-	-	-
中国银河证券股 份有限公司	1	-	-	-	-
中国中投证券有 限公司	1	-	-	-	-

限责任公司						
中泰证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有 限公司	2	-	-	-	-	-
安信证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-

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，能及时提供准确的信息资讯服务。

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：中银国际证券有限责任公司更名为中银国际证券股份有限公司。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
东兴证券股份有限公司	79,866.20	94.91%	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	4,279.80	5.09%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于修改中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同及托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2018 年 3 月 22 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 (%)
联接基金	1	2018/01/01 至 2018/06/30	60,623,108.00	14,000,000.00	6,000,000.00	68,623,108.00	94.57
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§ 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

2018 年 8 月 25 日