# 嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 2013 年度 报告摘要

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2014年3月26日

### §1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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2014年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金 |
| 基金简称 | 嘉实中创400ETF联接 |
| 基金主代码 | 070030 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 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 | 69,013,005.85份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 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 |
| 基金管理人名称 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国工商银行股份有限公司 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化,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0.35%,年化跟踪误差不超过4%。 |
| 投资策略 | 本基金为目标ETF的联接基金。主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。 |
| 业绩比较基准 | 中创400指数收益率*95% + 银行活期存款税后利率*5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为中创400ETF的联接基金,主要通过投资于中创400ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此,本基金的业绩表现与中创400指数及中创400ETF的表现密切相关。本基金的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。 |

2.2.1 目标基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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 | 赵会军 |
| | 联系电话 | (010)65215588 | (010)66105799 |
| | 电子邮箱 | service@jsfund.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-600-8800 | 95588 |
| 传真 | | (010)65182266 | (010)66105798 |

2.4 信息披露方式

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

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2013年 | 2012年3月22日(基金合同生效日)-2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 15,280,177.17 | -1,257,044.79 |
| 本期利润 | 51,448,515.67 | -21,719,887.86 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.4153 | -0.0853 |
| 本期加权平均净值利润率 | 38.88% | -9.00% |
| 本期基金份额净值增长率 | 38.86% | -9.14% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2013年末 | 2012年末 |
| 期末可供分配利润 | 9,928,630.60 | -20,148,986.01 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1439 | -0.0914 |
| 期末基金资产净值 | 87,076,283.00 | 200,417,099.03 |
| 期末基金份额净值 | 1.2617 | 0.9086 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2013年末 | 2012年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 26.17% | -9.14% |

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.73% | 1.50% | 0.70% | 1.52% | 0.03% | -0.02% |
| 过去六个月 | 23.93% | 1.48% | 24.81% | 1.51% | -0.88% | -0.03% |
| 过去一年 | 38.86% | 1.50% | 39.86% | 1.53% | -1.00% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 26.17% | 1.40% | 21.06% | 1.47% | 5.11% | -0.07% |

注:本基金业绩比较基准为:中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

中创400指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中,依据其前6个月的平均流通市值的比重和平均成交金额的比重按2:1的权重加权平均,然后将计算结果从高到低排序选取排名在位于101-500名的股票。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,计算方式如下:

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中创400指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return (t))×Benchmark (t-1)

其中t=1,2,3,…。

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

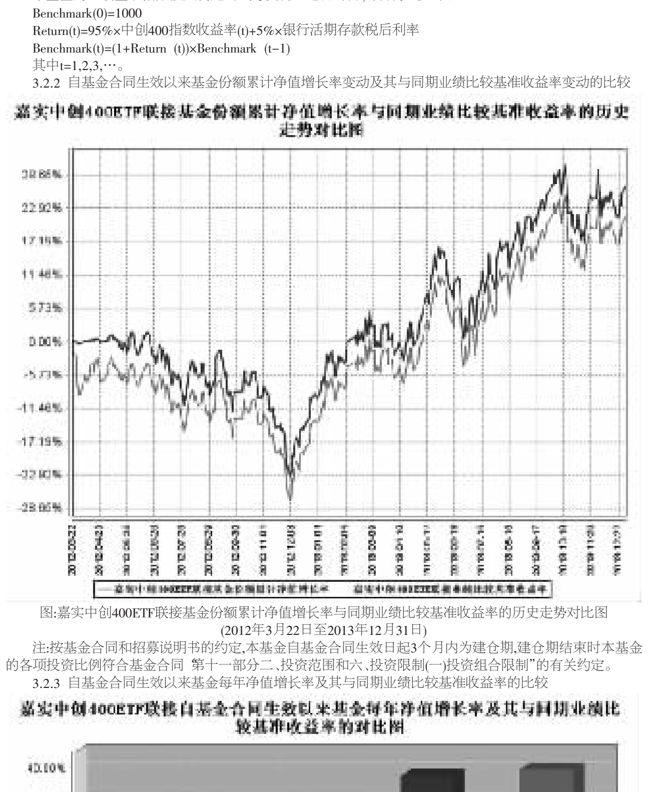
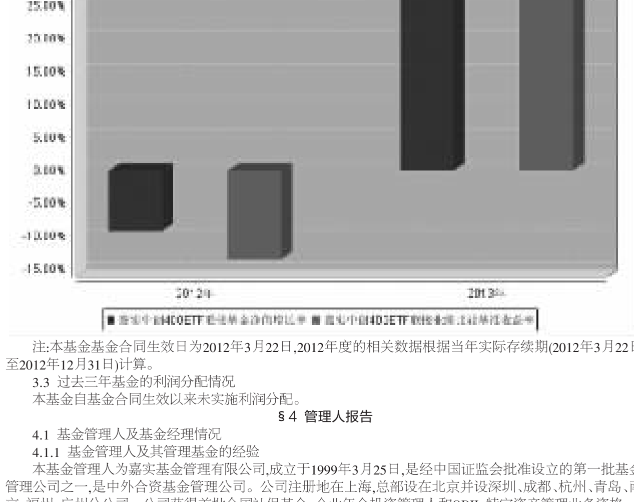



图:嘉实中创400ETF联接基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年3月22日至2013年12月31日)

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"第十一部分二、投资范围和六、投资限制(一)投资组合限制"的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较




注:本基金基金合同生效日为2012年3月22日,2012年度的相关数据根据当年实际存续期(2012年3月22日至2012年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

### §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地在上海,总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。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2013年12月31日,基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、54只开放式证券投资基金,具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、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、嘉实优质企业股票、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(QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、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、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、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、嘉实新兴市场双币分级债券、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。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券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 | | |
| 杨宇 | 本基金、嘉实中创400ETF、嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实中证500ETF及其联接基金、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证中期国债ETF及其联接基金基金经理、公司指数投资部总监 | 2012年3月22日 | - | 15年 | 曾先后担任平安保险投资管理中心基金交易室主任及天同基金管理有限公司投资部总经理、万家(天同)180指数基金经理。2004年7月加入嘉实基金。南开大学经济学硕士,具有基金从业资格,中国国籍。 |

注:(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日;(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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》,按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定,从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,杜绝不同投资组合之间进行利益输送,保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议,并在投资决策委员会的制度规范下独立决策,实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离,任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利,共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则,保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素,交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;对投资交易行为进行监察稽核,通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息,每季度和每年度完成公平交易专项稽核。

报告期内,公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的,合计10次,均为旗下指数基金或ETF因被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易,但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0.04%,年度化拟合偏离度为0.57%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.35%的限制。

报告期内,中创400指数上涨42.1%。本基金的跟踪误差主要来源于本基金的申购赎回、样本股分红、样本股调整的冲击以及目标ETF偏离。

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1.2617元;本报告期基金份额净值增长率为38.86%,业绩比较基准收益率为39.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中创400指数挑选在深圳证券交易所中小企业版及创业板上市的400只A股组成,其成份股所属企业具备成长性高、区域优势明显、且创新能力强的特性。

本基金为目标ETF的联接基金。主要通过投资于目标ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,本基金将在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下,继续秉承指数化投资管理策略,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,进一步降低基金的跟踪误差,力求获得与目标ETF所跟踪的标的指数相近的平均收益率。期望中创400联接基金将为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

4.6 管理人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、监察稽核等部门负责人组成,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历。报告期内,固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员,基金经理参加估值专业委员会会议,但不介入基金日常估值业务;参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所,中国证券登记结算有限责任公司,中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未实施利润分配。根据基金合同第十五部分三、基金收益分配原则的约定,报告期内未实施利润分配符合法律法规的规定及基金合同的相关约定。

### §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,本基金托管人在对嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中,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,嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、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,嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金2013年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

### §6 审计报告

嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金2013年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计、注册会计师许康玮、洪磊签字出具了"无保留意见的审计报告"(普华永道中天审字(2014)第20494号)。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

### §7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日: 2013年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2013年12月31日 | 上年度末 2012年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 5,177,872.00 | 11,042,308.42 |
| 结算备付金 | | 17,902.47 | - |
| 存出保证金 | | 14,168.89 | 333,333.34 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 82,464,440.50 | 189,252,064.46 |
| 其中:股票投资 | | 564,370.00 | 2,050,681.85 |
| 基金投资 | | 81,900,070.50 | 187,201,382.61 |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 2,692,486.01 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 1,060.41 | 2,152.46 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,157,107.71 | 45,804.52 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | 309,758.75 | - |
| 资产总计 | | 89,142,310.73 | 203,368,149.21 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2013年12月31日 | 上年度末 2012年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 1,437,458.49 | - |
| 应付赎回款 | | 262,134.99 | 2,467,733.08 |
| 应付管理人报酬 | | 2,822.94 | 6,308.61 |
| 应付托管费 | | 564.58 | 1,261.71 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 12,206.47 | 6,446.43 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 350,840.26 | 469,300.35 |
| 负债合计 | | 2,066,027.73 | 2,951,050.18 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 69,013,005.85 | 220,566,085.04 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 18,063,277.15 | -20,148,986.01 |
| 所有者权益合计 | | 87,076,283.00 | 200,417,099.03 |
| 负债和所有者权益总计 | | 89,142,310.73 | 203,368,149.21 |

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.2617元,基金份额总额69,013,005.85份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间 2012年3月22日(基金合同生效日)至2012年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 52,238,107.82 | -20,794,385.50 |
| 1.利息收入 | | 65,284.83 | 902,079.43 |
| 其中:存款利息收入 | 7.4.7.11 | 65,284.83 | 253,675.33 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 648,404.10 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益 | | 15,749,083.28 | -1,454,053.54 |
| 其中:股票投资收益 | 7.4.7.12 | 1,887,420.33 | -205,407.58 |
| 基金投资收益 | 7.4.7.13 | 13,842,727.36 | -1,519,191.45 |
| 债券投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 18,935.59 | 270,545.49 |
| 3.公允价值变动收益 | 7.4.7.17 | 36,168,338.50 | -20,462,843.07 |
| 4.汇兑收益 | | - | - |
| 5.其他收入 | 7.4.7.18 | 255,401.21 | 220,431.68 |
| 减:二、费用 | | 789,592.15 | 925,502.36 |
| 1.管理人报酬 | | 52,485.13 | 301,652.15 |
| 2.托管费 | | 10,496.98 | 60,330.48 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | 7.4.7.19 | 369,969.55 | 273,766.63 |
| 5.利息支出 | | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.其他费用 | 7.4.7.20 | 356,640.49 | 289,753.10 |
| 三、利润总额 | | 51,448,515.67 | -21,719,887.86 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润 | | 51,448,515.67 | -21,719,887.86 |

注:本基金合同生效日为2012年3月22日,上年度可比期间是指自基金合同生效日2012年3月22日至2012年12月31日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 220,566,085.04 | -20,148,986.01 | 200,417,099.03 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 51,448,515.67 | 51,448,515.67 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -151,553,079.19 | -13,236,252.51 | -164,789,331.70 |
| 其中:1.基金申购款 | 104,532,877.50 | 13,111,118.01 | 117,643,995.51 |
| 2.基金赎回款 | -256,085,956.69 | -26,347,370.52 | -282,433,327.21 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 69,013,005.85 | 18,063,277.15 | 87,076,283.00 |
| 项目 | 上年度可比期间 2012年3月22日(基金合同生效日)至2012年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 378,434,953.27 | - | 378,434,953.27 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -21,719,887.86 | -21,719,887.86 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -157,868,868.23 | 1,570,901.85 | -156,297,966.38 |
| 其中:1.基金申购款 | 21,616,989.87 | -1,569,988.83 | 20,047,001.04 |
| 2.基金赎回款 | -179,485,858.10 | 3,140,890.68 | -176,344,967.42 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 220,566,085.04 | -20,148,986.01 | 200,417,099.03 |

注:本基金合同生效日为2012年3月22日,上年度可比期间是指自基金合同生效日2012年3月22日至2012年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

______赵学军______ ______李松林______ ____王红____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 嘉实基金管理有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(中国工商银行) | 基金托管人、基金代销机构 |
| 中诚信托有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 立信投资有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 德意志资产管理(亚洲)有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 中创400交易型开放式指数证券投资基金(嘉实中创400ETF) | 本基金是该基金的联接基金 |

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2013年1月1日至2013年12月31日)及上年度可比期间(2012年3月22日(基金合同生效日)至2012年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间 2012年3月22日(基金合同生效日)至2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 52,485.13 | 301,652.15 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 196,442.62 | 308,846.42 |

注1:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。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扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.5%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-基金财产中目标ETF份额所对应资产净值)(若为负数,则取0)×0.5% / 当年天数。

注2:根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议,客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间 2012年3月22日(基金合同生效日)至2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 10,496.98 | 60,330.48 |

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.1%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=(前一日的基金资产净值-基金财产中目标ETF份额所对应资产净值)(若为负数,则取0)×0.1% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期(2013年1月1日至2013年12月31日)及上年度可比期间(2012年3月22日(基金合同生效日)至2012年12月31日),本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期(2013年1月1日至2013年12月31日)及上年度可比期间(2012年3月22日(基金合同生效日)至2012年12月31日),基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末(2013年12月31日)及上年度末(2012年12月31日),其他关联方未持有本基金。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 | | 上年度可比期间 2012年3月22日(基金合同生效日)至2012年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 5,177,872.00 | 64,218.12 | 11,042,308.42 | 243,793.66 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期(2013年1月1日至2013年12月31日)及上年度可比期间(2012年3月22日(基金合同生效日)至2012年12月31日),本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末,本基金持有64,255,508.00份目标ETF基金份额(2012年12月31日:207,218,710.00份),占其总份额的比例为87.35%(2012年12月31日:79.83%)。

7.4.5 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末(2013年12月31日),本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 002193 | 山东如意 | 2013年7月29日 | 重大事项停牌 | 7.65 | 2014年3月3日 | 8.42 | 1,800 | 13,770.00 | 13,770.00 | - |
| 002665 | 首航节能 | 2013年10月24日 | 重大事项停牌 | 26.77 | 未知 | 未知 | 300 | 7,859.25 | 8,031.00 | - |
| 300056 | 三维丝 | 2013年12月30日 | 重大事项停牌 | 25.01 | 2014年2月13日 | 27.51 | 200 | 5,117.00 | 5,002.00 | - |
| 002195 | 海隆软件 | 2013年11月1日 | 重大事项停牌 | 15.80 | 2014年1月16日 | 17.38 | 100 | 1,519.67 | 1,580.00 | - |
| 300143 | 星河生物 | 2013年11月18日 | 重大事项停牌 | 9.80 | 未知 | 未知 | 100 | 968.80 | 980.00 | - |

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末(2013年12月31日),本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末(2013年12月31日),本基金无交易所市场债券正回购余额。

### §8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 564,370.00 | 0.63 |
| | 其中:股票 | 564,370.00 | 0.63 |
| 2 | 基金投资 | 81,900,070.50 | 91.88 |
| 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 | 5,195,774.47 | 5.83 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,482,095.76 | 1.66 |
| | 合计 | 89,142,310.73 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 980.00 | 0.00 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 506,884.00 | 0.58 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 41,488.00 | 0.05 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 6,360.00 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 3,468.00 | 0.00 |
| 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 | 5,190.00 | 0.01 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 564,370.00 | 0.65 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002240 | 威华股份 | 22,700 | 325,745.00 | 0.37 |
| 2 | 002193 | 山东如意 | 1,800 | 13,770.00 | 0.02 |
| 3 | 002565 | 上海绿新 | 600 | 12,036.00 | 0.01 |
| 4 | 300111 | 向日葵 | 2,900 | 10,498.00 | 0.01 |
| 5 | 300113 | 顺网科技 | 200 | 10,254.00 | 0.01 |
| 6 | 300205 | 天喻信息 | 300 | 9,975.00 | 0.01 |
| 7 | 002013 | 中航机电 | 600 | 9,378.00 | 0.01 |
| 8 | 300074 | 华平股份 | 400 | 8,976.00 | 0.01 |
| 9 | 002123 | 荣信股份 | 1,200 | 8,688.00 | 0.01 |
| 10 | 002037 | 久联发展 | 800 | 8,040.00 | 0.01 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(http://www.jsfund.cn)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 300058 | 蓝色光标 | 129,558.00 | 0.06 |
| 2 | 002400 | 省广股份 | 115,609.00 | 0.06 |
| 3 | 300039 | 上海凯宝 | 94,529.00 | 0.05 |
| 4 | 002477 | 雏鹰农牧 | 93,056.35 | 0.05 |
| 5 | 300257 | 开山股份 | 89,543.00 | 0.04 |
| 6 | 300059 | 东方财富 | 89,341.00 | 0.04 |
| 7 | 300026 | 红日药业 | 83,579.00 | 0.04 |
| 8 | 300072 | 三聚环保 | 81,346.00 | 0.04 |
| 9 | 300124 | 汇川技术 | 81,025.90 | 0.04 |
| 10 | 002185 | 华天科技 | 80,346.00 | 0.04 |
| 11 | 300002 | 神州泰岳 | 77,181.00 | 0.04 |
| 12 | 300273 | 和佳股份 | 76,928.00 | 0.04 |
| 13 | 002052 | 同洲电子 | 76,409.00 | 0.04 |
| 14 | 002573 | 国电清新 | 75,832.00 | 0.04 |
| 15 | 300079 | 数码视讯 | 75,194.00 | 0.04 |
| 16 | 002431 | 棕榈园林 | 75,167.00 | 0.04 |
| 17 | 300017 | 网宿科技 | 72,872.00 | 0.04 |
| 18 | 002410 | 广联达 | 71,951.00 | 0.04 |
| 19 | 002429 | 兆驰股份 | 71,874.00 | 0.04 |
| 20 | 002482 | 广田股份 | 71,534.00 | 0.04 |

8.4.2 累计卖出金额前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 300058 | 蓝色光标 | 2,035,314.31 | 1.02 |
| 2 | 002456 | 欧菲光 | 1,489,226.85 | 0.74 |
| 3 | 002400 | 省广股份 | 1,397,771.20 | 0.70 |
| 4 | 300088 | 长信科技 | 1,362,209.40 | 0.68 |
| 5 | 002344 | 海宁皮城 | 1,277,217.99 | 0.64 |
| 6 | 300257 | 开山股份 | 1,242,797.59 | 0.62 |
| 7 | 300072 | 三聚环保 | 1,186,129.74 | 0.59 |
| 8 | 002294 | 信立泰 | 1,155,613.74 | 0.58 |
| 9 | 300039 | 上海凯宝 | 1,093,263.99 | 0.55 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 1,084,539.38 | 0.54 |
| 11 | 300228 | 富瑞特装 | 1,075,420.21 | 0.54 |
| 12 | 300079 | 数码视讯 | 1,066,234.47 | 0.53 |
| 13 | 300133 | 华策影视 | 1,062,999.19 | 0.53 |
| 14 | 300026 | 红日药业 | 1,045,818.84 | 0.52 |
| 15 | 300124 | 汇川技术 | 1,021,409.84 | 0.51 |
| 16 | 002477 | 雏鹰农牧 | 1,019,375.27 | 0.51 |
| 17 | 300251 | 光线传媒 | 1,016,586.81 | 0.51 |
| 18 | 300273 | 和佳股份 | 1,013,051.76 | 0.51 |
| 19 | 002273 | 水晶光电 | 997,527.57 | 0.50 |
| 20 | 300002 | 神州泰岳 | 971,681.68 | 0.48 |

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本(成交)总额 | 12,847,688.41 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 175,599,421.57 |

注:8.4.1项"买入金额"、8.4.2项"卖出金额"及8.4.3项"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买入或卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

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

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

8.10 期末投资目标基金明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 嘉实中创400ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 嘉实基金管理有限公司 | 81,900,070.50 | 94.06 |

8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.13.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.13.3 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 | 14,168.89 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,060.41 |
| 5 | 应收申购款 | 1,157,107.71 |
| 6 | 其他应收款 | 309,758.75 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 1,482,095.76 |

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 期末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 | 002193 | 山东如意 | 13,770.00 | 0.02 | 重大事项停牌 |

### §9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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 |
| 2,526 | 27,321.06 | 55,134.24 | 0.08% | 68,957,871.61 | 99.92% |

9.2 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。

### §10 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2012年3月22日)基金份额总额 | 378,434,953.27 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 220,566,085.04 |
| 本报告期基金总申购份额 | 104,532,877.50 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 256,085,956.69 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 69,013,005.85 |

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,基金总赎回份额含转换出份额。

### §11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1)基金管理人的重大人事变动情况

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费50,000.00元,该审计机构已连续2年提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 基金交易 | | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2 | 188,447,114.98 | 100.00% | 1,327,380.34 | 100.00% | 170,729.36 | 100.00% | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 中国中投证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - | - | - |

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。

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

嘉实基金管理有限公司
2014年3月26日