

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:2013年8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。本基金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基金合同规定，于2013年8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基金合同。

本年度报告摘要概括自半年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期财务数据于2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§ 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	98,010,125.19份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 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	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

2.2.1 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，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过±0.35%，年化跟踪误差不超过4%。

2.2.2 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比例进行复制，本基金将所有可投资的金融工具按照行业分类，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.3 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%

本基金为中创400ETF的联接基金，主要通过投资于中创400ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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。

2.2.4 风险收益特征

本基金在完全复制法的基础上，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.5 基金产品说明

本基金在完全复制法的基础上，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.6 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，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过±0.2%，年化跟踪误差不超过4%。

2.2.7 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比例进行复制，本基金将所有可投资的金融工具按照行业分类，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.8 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%

本基金为中创400ETF的联接基金，主要通过投资于中创400ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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。

2.2.9 基金产品说明

本基金在完全复制法的基础上，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.10 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，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过±0.2%，年化跟踪误差不超过4%。

2.2.11 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比例进行复制，本基金将所有可投资的金融工具按照行业分类，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.12 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%

本基金为中创400ETF的联接基金，主要通过投资于中创400ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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。

2.2.13 基金产品说明

本基金在完全复制法的基础上，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.14 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，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过±0.2%，年化跟踪误差不超过4%。

2.2.15 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比例进行复制，本基金将所有可投资的金融工具按照行业分类，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.16 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%

本基金为中创400ETF的联接基金，主要通过投资于中创400ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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。

2.2.17 基金产品说明

本基金在完全复制法的基础上，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.18 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，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过±0.2%，年化跟踪误差不超过4%。

2.2.19 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比例进行复制，本基金将所有可投资的金融工具按照行业分类，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.20 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%

本基金为中创400ETF的联接基金，主要通过投资于中创400ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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。

2.2.21 基金产品说明

本基金在完全复制法的基础上，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.22 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，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过±0.2%，年化跟踪误差不超过4%。

2.2.23 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比例进行复制，本基金将所有可投资的金融工具按照行业分类，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.24 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%

本基金为中创400ETF的联接基金，主要通过投资于中创400ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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。

2.2.25 基金产品说明

本基金在完全复制法的基础上，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.26 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，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过±0.2%，年化跟踪误差不超过4%。

2.2.27 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比例进行复制，本基金将所有可投资的金融工具按照行业分类，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.28 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%

本基金为中创400ETF的联接基金，主要通过投资于中创400ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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。

2.2.29 基金产品说明

本基金在完全复制法的基础上，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.30 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，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过±0.2%，年化跟踪误差不超过4%。

2.2.31 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比例进行复制，本基金将所有可投资的金融工具按照行业分类，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.32 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%

本基金为中创400ETF的联接基金，主要通过投资于中创400ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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。

2.2.33 基金产品说明

本基金在完全复制法的基础上，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.34 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，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过±0.2%，年化跟踪误差不超过4%。

2.2.35 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比例进行复制，本基金将所有可投资的金融工具按照行业分类，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.36 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%

本基金为中创400ETF的联接基金，主要通过投资于中创400ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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。

2.2.37 基金产品说明

本基金在完全复制法的基础上，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.38 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，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过±0.2%，年化跟踪误差不超过4%。

2.2.39 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比例进行复制，本基金将所有可投资的金融工具按照行业分类，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.40 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%

本基金为中创400ETF的联接基金，主要通过投资于中创400ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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。

2.2.41 基金产品说明

本基金在完全复制法的基础上，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.42 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，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过±0.2%，年化跟踪误差不超过4%。

2.2.43 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比例进行复制，本基金将所有可投资的金融工具按照行业分类，将行业权重与标的指数的行业权重进行对比，根据差额调整投资组合，以达到与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.44 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%

本基金为中创400ETF的联接基金，主要通过投资于中创400ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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。

2.2.45 基金产品说明