

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

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长期投资回报。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对于报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度和程序
4.3.1.1 公平交易制度的制定
4.3.1.2 公平交易制度的执行

4.3.2 异常交易行为的专项说明
4.3.2.1 异常交易行为的认定
4.3.2.2 异常交易行为的监控

4.3.3 关联交易行为的专项说明
4.3.3.1 关联关系的认定
4.3.3.2 关联交易的审批

4.3.4 关联交易行为的专项说明
4.3.4.1 关联交易的审批
4.3.4.2 关联交易的披露

4.3.5 关联交易行为的专项说明
4.3.5.1 关联交易的审批
4.3.5.2 关联交易的披露

4.3.6 关联交易行为的专项说明
4.3.6.1 关联交易的审批
4.3.6.2 关联交易的披露

4.3.7 关联交易行为的专项说明
4.3.7.1 关联交易的审批
4.3.7.2 关联交易的披露

4.3.8 关联交易行为的专项说明
4.3.8.1 关联交易的审批
4.3.8.2 关联交易的披露

4.3.9 关联交易行为的专项说明
4.3.9.1 关联交易的审批
4.3.9.2 关联交易的披露

4.3.10 关联交易行为的专项说明
4.3.10.1 关联交易的审批
4.3.10.2 关联交易的披露

4.3.11 关联交易行为的专项说明
4.3.11.1 关联交易的审批
4.3.11.2 关联交易的披露

4.3.12 关联交易行为的专项说明
4.3.12.1 关联交易的审批
4.3.12.2 关联交易的披露

4.3.13 关联交易行为的专项说明
4.3.13.1 关联交易的审批
4.3.13.2 关联交易的披露

4.3.14 关联交易行为的专项说明
4.3.14.1 关联交易的审批
4.3.14.2 关联交易的披露

4.3.15 关联交易行为的专项说明
4.3.15.1 关联交易的审批
4.3.15.2 关联交易的披露

4.3.16 关联交易行为的专项说明
4.3.16.1 关联交易的审批
4.3.16.2 关联交易的披露

4.3.17 关联交易行为的专项说明
4.3.17.1 关联交易的审批
4.3.17.2 关联交易的披露

4.3.18 关联交易行为的专项说明
4.3.18.1 关联交易的审批
4.3.18.2 关联交易的披露

4.3.19 关联交易行为的专项说明
4.3.19.1 关联交易的审批
4.3.19.2 关联交易的披露

4.3.20 关联交易行为的专项说明
4.3.20.1 关联交易的审批
4.3.20.2 关联交易的披露

4.3.21 关联交易行为的专项说明
4.3.21.1 关联交易的审批
4.3.21.2 关联交易的披露

4.3.22 关联交易行为的专项说明
4.3.22.1 关联交易的审批
4.3.22.2 关联交易的披露

4.3.23 关联交易行为的专项说明
4.3.23.1 关联交易的审批
4.3.23.2 关联交易的披露

4.3.24 关联交易行为的专项说明
4.3.24.1 关联交易的审批
4.3.24.2 关联交易的披露

4.3.25 关联交易行为的专项说明
4.3.25.1 关联交易的审批
4.3.25.2 关联交易的披露

4.3.26 关联交易行为的专项说明
4.3.26.1 关联交易的审批
4.3.26.2 关联交易的披露

4.3.27 关联交易行为的专项说明
4.3.27.1 关联交易的审批
4.3.27.2 关联交易的披露

4.3.28 关联交易行为的专项说明
4.3.28.1 关联交易的审批
4.3.28.2 关联交易的披露

4.3.29 关联交易行为的专项说明
4.3.29.1 关联交易的审批
4.3.29.2 关联交易的披露

4.3.30 关联交易行为的专项说明
4.3.30.1 关联交易的审批
4.3.30.2 关联交易的披露

4.3.31 关联交易行为的专项说明
4.3.31.1 关联交易的审批
4.3.31.2 关联交易的披露

4.3.32 关联交易行为的专项说明
4.3.32.1 关联交易的审批
4.3.32.2 关联交易的披露

4.3.33 关联交易行为的专项说明
4.3.33.1 关联交易的审批
4.3.33.2 关联交易的披露

4.3.34 关联交易行为的专项说明
4.3.34.1 关联交易的审批
4.3.34.2 关联交易的披露

4.3.35 关联交易行为的专项说明
4.3.35.1 关联交易的审批
4.3.35.2 关联交易的披露

4.3.36 关联交易行为的专项说明
4.3.36.1 关联交易的审批
4.3.36.2 关联交易的披露

4.3.37 关联交易行为的专项说明
4.3.37.1 关联交易的审批
4.3.37.2 关联交易的披露

4.3.38 关联交易行为的专项说明
4.3.38.1 关联交易的审批
4.3.38.2 关联交易的披露

4.3.39 关联交易行为的专项说明
4.3.39.1 关联交易的审批
4.3.39.2 关联交易的披露

4.3.40 关联交易行为的专项说明
4.3.40.1 关联交易的审批
4.3.40.2 关联交易的披露

4.3.41 关联交易行为的专项说明
4.3.41.1 关联交易的审批
4.3.41.2 关联交易的披露

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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

8.4.2 累计卖出金额前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with columns: 买入股票成本(成交总额), 卖出股票收入(成交总额)

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(成交对价)成交金额填列,不考虑相关交易费用。

8.5 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

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权证投资明细

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

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

8.9 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权证投资明细

8.10 期末投资组合明细

Table with columns: 序号, 基金名称, 基金类型, 运作方式, 基金管理人, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.13 投资组合报告附注

8.14 报告期末本基金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。

8.15 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。

8.16 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

8.17 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券

8.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

Table with columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者持有基金份额, 个人投资者持有基金份额

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的变动

9.4 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

9.5 基金投资策略的重大变化

9.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

9.7 管理人、托管人及其高级管理人员受行政处罚或处分的情况

9.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易成交金额, 基金交易成交金额, 债券交易成交金额, 权证交易成交金额, 其他交易成交金额, 备注

注:1.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给该券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

(1) 经营行为规范,在最近一年无重大违规行为;

(2) 公司财务状况良好;

(3) 有良好的内部控制,在业内有良好的声誉;

(4) 有较深的研究实力,能及时、全面、定期提供高质量宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告;

(5) 建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息增值服务。

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,基金管理人将与被选定的券商签订协议,并由基金托管人复核。

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。