中创400交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第四季度报告

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
报告送出日期:2016年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	67,561,264.00份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	2,839,217.02
2.本期利润	45,342,729.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.6554
4.期末基金资产净值	172,214,937.48
5.期末基金份额净值	2.5490

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)上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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	33.89%	2.21%	35.12%	2.26%	-1.23%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

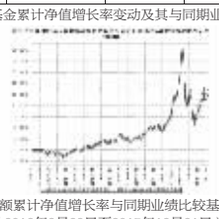

图:嘉实中创400ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年3月22日至2015年12月31日)

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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何如	本基金、嘉实中创400ETF、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、嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实中证500ETF及其联接、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(ODII-LOF)、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(ODII-FOF-LOF)基金经理	2014年5月9日	-	9年	曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司(IA-Clarington Investments Inc.)、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.),2007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,现任公司指数投资部基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

注:(1)任职日期是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、《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 公平交易专项说明

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2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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场4季度大幅反弹。经历了3季度的大幅下跌,经济下行、人民币贬值、市场估值过高等风险均得到了较大的释放,随着利好政策的不断释放,市场信心逐渐修复,风险偏好上行,4季度市场出现了较好的投资机会。报告期内,上证综指上涨了16%,上证50上涨了12.8%,中证500上涨了26.2%,创业板指数上涨了30.3%。分行业看,成长型行业整体表现更好,而低估值价值型行业表现较差,不过,在宝能举牌万科的带动下,价值型行业中的房地产表现非常突出。

由于对4季度A股市场的投资机会比较乐观,报告期内,本基金仓位一直维持在90%以上,组合的配置大方向依旧延续了以老龄化和节能环保为主线的配置思路,并且阶段性提高了向新经济转型的小市值股票的配置比例。

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1.739元;本报告期基金份额净值增长率为34.81%,业绩比较基准收益率为15.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年的市场环境,预计政策效果会逐渐显现,工业生产反弹,消费链条上的经济活动会出现一定的改善,但是由于需求的疲弱,出口和投资链条难以出现明显改善,利润的增长主要取决于供给侧改革的力度和效果,人民币贬值的趋势已经形成,但预计幅度可控,总体判断,2016年的经济环境相对平稳,不会出现系统性风险,也不会有大规模刺激,缓慢去杠杆,无风险利率继续下行,美国首次加息落定后,市场风险偏好相对稳定。资金延续存量博弈,在市场整体估值较高的背景下,全年来看,A股行情是结构性的,估值过高的中小盘公司(其实,从市值角度看,已不能称其为小公司,但从利润角度看很小)将在供给量大增(注册制)以及减持的压力下去伪存真,全年来说,GARP选股策略可能更有优势。

对于2016年1季度的市场而言,整体处于真空期,两会前对于政策的预期会带来主题性投资机会。转型和升级主题催化的中小盘股票估值高企,而传统意义上的价值股估值修复空间也有限,因此,市场风格大概率相对均衡。

在经济转型期的经济、政治环境下,寻找符合改革和转型主线的主题标的,是组合长期取得超额收益的最主要手段,符合这一主线的行业和个股是组合的核心配置,如大健康、节能环保、新能源汽车、移动互联等。由于我们判断2016年个股会分化严重,因此,组合会更加强调所选择标的的质量和催化因素的兑现性。

从主题层面,我们关注国企改革、并购重组、跨界转型、IP、两岸半导体行业整合等。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	170,685,191.45	98.88
	其中:股票	170,685,191.45	98.88
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	1,907,667.54	1.11
7	其他资产	32,188.57	0.02
	合计	172,625,047.56	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	2,595,718.79	1.51
B	采矿业	1,210,892.40	0.70
C	制造业	122,867,221.14	71.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,099,838.12	0.64
E	建筑业	3,887,811.95	2.26
F	批发和零售业	3,554,713.40	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	599,473.16	0.35
H	住宿和餐饮业	182,390.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,478,271.76	14.79
J	金融业	-	-
K	房地产业	982,717.59	0.57
L	租赁和商务服务业	1,442,251.15	0.84
M	科学研究和技术服务业	1,650,162.38	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	719,226.75	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,705,376.94	0.99
R	文化、体育和娱乐业	1,973,094.00	1.15
S	综合	-	-
	合计	169,949,159.53	98.68

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	318,218.40	0.18
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	417,813.52	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	736,031.92	0.43

5.3 报告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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	002018	华信国际	49,520	2,182,841.60	1.27
2	002466	天齐锂业	9,630	1,355,422.50	0.79
3	002681	奋达科技	26,500	1,158,050.00	0.67
4	300113	顺网科技	10,391	1,053,335.67	0.61
5	002460	赣锋锂业	15,320	964,087.60	0.56
6	002407	多氟多	12,382	944,251.32	0.55
7	002368	太极股份	13,808	926,516.80	0.54
8	300028	金亚科技	25,870	892,773.70	0.52
9	002308	威创股份	35,543	876,134.95	0.51
10	002268	卫士通	15,582	875,364.22	0.51

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	002306	*ST云网	45,316	417,813.52	0.24
2	002239	奥特佳	17,370	318,218.40	0.18

注:报告期末,本基金仅持有上述2只积极投资股票。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	31,889.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	298.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	32,188.57

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002018	华信国际	2,182,841.60	1.27	重大事项停牌
2	300028	金亚科技	892,773.70	0.52	重大事项停牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002306	*ST云网	417,813.52	0.24	重大事项停牌
2	002239	奥特佳	318,218.40	0.18	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	70,561,264.00
报告期期间基金总申购份额	9,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	12,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	67,561,264.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,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。

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 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

8.3 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
2016年1月21日

嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2015】第四季度报告

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
报告送出日期:2016年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

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
报告期末基金份额总额	73,444,146.06份
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;将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。
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。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。
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

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

2.1.2 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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	2,055,791.78
2.本期利润	44,069,954.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.5809
4.期末基金资产净值	174,518,372.07
5.期末基金份额净值	2.3762

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)上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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	32.17%	2.10%	33.21%	2.15%	-1.04%	-0.05%

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

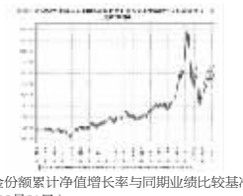

图:嘉实中创400ETF联接基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年3月22日至2015年12月31日)

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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何如	本基金、嘉实中创400ETF、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、嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实中证500ETF及其联接、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(ODII-LOF)、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(ODII-FOF-LOF)基金经理	2014年5月9日	-	9年	曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司(IA-Clarington Investments Inc.)、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007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,现任公司指数投资部基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

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 公平交易专项说明

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2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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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0.06%,年度化拟合偏离度为0.97%。符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.35%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2.3762元;本报告期基金份额净值增长率为32.17%,业绩比较基准收益率为33.21%。

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。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,077,119.00	2.89
	其中:股票	5,077,119.00	2.89
2	基金投资	159,783,575.59	90.87
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	9,807,624.61	5.58
8	其他资产	1,167,732.94	0.66
	合计	175,836,052.14	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	83,113.00	0.05
B	采矿业	27,790.00	0.02
C	制造业	3,653,370.00	2.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,600.00	0.02
E	建筑业	120,911.00	0.07
F	批发和零售业	101,246.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	20,030.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	783,642.00	0.45
J	金融业	-	-
K	房地产业	28,966.00	0.02
L	租赁和商务服务业	50,450.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	49,939.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	16,136.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	37,476.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	68,450.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	5,077,119.00	2.91

5.3 报告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

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	002466	天齐锂业	400	56,300.00	0.03
2	300238	冠昊生物	700	39,669.00	0.02
3	002544	杰赛科技	1,100	32,615.00	0.02
4	002460	赣锋锂业	500	31,465.00	0.02
5	002407	多氟多	400	30,504.00	0.02
6	300113	顺网科技	300	30,411.00	0.02
7	002308	威创股份	1,200	29,580.00	0.02
8	300088	长信科技	2,100	29,463.00	0.02
9	300336	新文化	700	29,400.00	0.02
10	002268	卫士通	500	28,105.00	0.02

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	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	159,783,575.59	91.56

5.10 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。

5.11 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

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。

5.12.2

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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	71,897.93
2	应收证券清算款	847,036.31
3	应收股利	-
4	应收利息	2,170.83
5	应收申购款	246,627.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	1,167,732.94

5.12.4 报告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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300238	冠昊生物	39,669.00	0.02	重大事项停牌
2	002544	杰赛科技	32,615.00	0.02	重大事项停牌
3	300088	长信科技	29,463.00	0.02	重大事项停牌
4	300336	新文化	29,400.00	0.02	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	76,475,439.74
报告期期间基金总申购份额	32,403,867.17
减:报告期期间基金总赎回份额	35,435,160.85
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	73,444,146.06

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件;

(2)《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》;

(3)《嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》;

(4)《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)报告期内嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金公告的各项原稿。

8.2 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

8.3 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
2016年1月21日

嘉实主题新动力混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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
报告送出日期:2016年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实主题新动力混合
基金主代码	070021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月7日
报告期末基金份额总额	638,412,496.12份
投资目标	充分把握驱动中国经济发展和结构转型所带来的主题性投资机会,并在主题的指引下精选具有高成长潜力的上市公司,力争获取长期,持续,稳定的超额收益。
投资策略	通过发掘驱动经济增长及结构转型的新兴增长动力,并以新兴增长动力所指引的主题性投资机会作为主要的投资线索,将主题投资策略融入本基金自上而下的管理流程中。(1)力求前瞻性研判驱动经济发展及转型的新兴增长动力所带来的投资主题;(2)根据投资主题的广度及数量,以