

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、准确性负责。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2013年8月20日复核了本报告中的财务数据、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。

基金管理人秉承以诚实信用、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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告日期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

## 2 基金基本情况

## 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:106,561,264.00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1%。

投资策略:本基金将完全复制法，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该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

姓名 胡勇钦 赵会军

信息披露负责人 联系电话 (010)65215588 电子邮箱 service@jrfund.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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网址 http://www.jrfund.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

## § 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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)

本期已实现收益 11,741,562.25

本期利润 36,147,019.60

加权平均基金份额本期利润 0.1882

本期平均净值增长率 18.58%

本期基金份额净值增长率 12.66%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配利润 1,899,534.71

期末可供分配基金份额利润 0.0178

期末基金份额净值 108,460,798.71

期末基金份额净值 1.0178

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；②本期可供分配利润为期末可供分配利润减去本期公允价值变动收益；③本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实时净值；④期末可供分配利润乘以期末基金份额净值即为基金的最新净值。

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 份额净值增长率为(%) 准确率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -12.60% 2.09% -12.78% 2.11% 0.18% -0.02%

过去三个月 -1.17% 1.73% 0.76% 1.75% 0.41% -0.02%

过去六个月 12.66% 1.63% 12.63% 1.64% 0.03% -0.01%

过去一年 4.54% 1.58% 4.99% 1.59% -0.45% -0.01%

自基金合同生效起至今 1.78% 1.45% -3.36% 1.53% 5.14% -0.08%

3.2.2 自基金合同成立以来基金份额累计净值增长率变化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图 对比图

2012年3月22日至2013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。

## 3.2.3 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经验

本基金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。公司注册资本1亿元人民币，总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得了首批全国社保基金企业年金投资管理人和QDII外汇资金管理业务资格。

截止2013年6月30日，基金管理人共管理两只封闭式证券投资基金，47只开放式证券投资基金，具体包括嘉实泰和封闭基金、嘉实红利封闭基金、嘉实增长混合基金、嘉实增长混合基金、嘉实稳健混合基金、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实超短线债券、嘉实主题组合基金、嘉实策略组合、嘉实海外中国股票(QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实量化债券、嘉实回报基金、嘉实稳健配置基金、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、嘉实中创400指数(QDII-LOF)、嘉实主动债券、嘉实定期开放股票型基金、嘉实货币基金、嘉实货币基金、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)、嘉实研究财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证期中期国债(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(LOF)、嘉实中证中期国债(LOF)、嘉实增强定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票、QDII等证券投资基金。其中嘉实增长混合基金、嘉实稳健混合基金、嘉实回报基金3只开放式基金属于嘉实理财产品系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特别客户资金投资组合。

## 4.1.2 基金经理(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

杨宇 基金管理人 2012年3月 15年 曾先后担任平安保险投资管理中心基金交易中心主任及天同基金管理有限公司投资部总经理、万联(天同)180指数基金经理。2008年7月加入嘉实基金管理有限公司。拥有基金从业资格，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 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其他各项法律法规的规定，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，基金管理人严格按照证监会《证券投资基金公平交易行为监管指引(试行)》及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，通过对完善交易制度内部分工的公平性、公平交易执行细则、严格的流动性控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过IT系统和人工监盘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，本基金不存在异常交易行为。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金报告期内基金净值增长率、年度化拟合偏离度为0.11%，符合基金合同约定的平均跟踪误差不超±0.017%、年度化拟合偏离度为0.311%，符合基金合同约定的平均跟踪误差不超±0.2%的限制。

4.4.2 报告期内基金业绩表现

截至报告期末基金份额净值为1.0178元；本报告期基金份额净值增长率为12.66%，业绩比较基准收益率为12.63%。

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被动型资产管理产品的基金，我们将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基于基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争进一步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评价标准的说明

本基金评价标准以诚实信用、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。

4.7 管理人对报告期内基金的报

4.7.1 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.2 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.3 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.4 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.5 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.6 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.7 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.8 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.9 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.10 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.11 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.12 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.13 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.14 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.15 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.16 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.17 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.18 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.19 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.20 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.21 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.22 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.23 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.24 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.25 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.26 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.27 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.28 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.29 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.30 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.31 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.32 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.33 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.34 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.35 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.36 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.37 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.38 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.39 本报告期未通过关联交易单元进行交易的交易对手名称及交易情况

4.7.40 本报告期未通过关联交易单元进行交易