

信息披露 Disclosure

中创400交易型开放式指数证券投资基金

2013年度报告摘要

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基金的中申购赎回以及样本股调整的影响。

4.1 报告期内基金的投资表现和净值情况
截至本报告期末,本基金份额净值为1.2746元;本报告期基金份额净值增长率为41.09%,业绩比较基准收益率为42.10%。

4.5 管理人对于宏观经济、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板及创业板上市的400只个股组成,其成份股所属企业具备成长性高、区域优势明显、且创新能力强的特点。

4.6 管理人对于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约定的,日常估值由基金管理人及基金托管人一同进行。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
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日至2012年12月31日)期间,本基金未实施利润分配。

5.1 报告期内本基金托管人履行受托职责的情况说明
报告期内,本基金托管人在对中创400交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,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。

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
报告期内,中创400交易型开放式指数证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在中创400交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、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。

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(嘉实基金管理有限公司)对中创400交易型开放式指数证券投资基金2013年度财务报告、基金净值报告、基金年度报告等文件进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

5.4 审计报告
中创400交易型开放式指数证券投资基金2013年度财务报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师李洪基签字出具了“无保留意见审计报告”。

7.1 资产负债表
会计主体:中创400交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

7.2 利润表
会计主体:中创400交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

7.3 所有者权益变动表
会计主体:中创400交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

7.4 现金流量表
会计主体:中创400交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

7.5 公允价值
公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.6 金融资产和金融负债的公允价值
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.7 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.8 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.9 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.10 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.11 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.12 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.13 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.14 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.15 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.16 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.17 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.18 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.19 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.20 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.21 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.22 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.23 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.24 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.25 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.26 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.27 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.28 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.29 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.30 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.31 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.32 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.33 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.34 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.35 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.36 金融工具
本基金持有的金融资产和金融负债的公允价值,按照公允价值计量结果所属的层次,对公允价值计量结果具有重要影响的输入值,以及公允价值计量的方法。

7.4.1 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日至2012年12月31日)期间,本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.2 关联方报酬
7.4.2.1 基金管理费
7.4.2.2 基金托管费

7.4.3 支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4 支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.5 期末未支付基金管理人报酬及基金托管人报酬的应付项目
7.4.5.1 期末未支付基金管理人报酬

7.4.5.2 期末未支付基金托管人报酬

7.4.6 关联方交易
7.4.6.1 关联方交易
7.4.6.2 关联方交易

7.4.7 关联方交易
7.4.7.1 关联方交易
7.4.7.2 关联方交易

7.4.8 关联方交易
7.4.8.1 关联方交易
7.4.8.2 关联方交易

7.4.9 关联方交易
7.4.9.1 关联方交易
7.4.9.2 关联方交易

7.4.10 关联方交易
7.4.10.1 关联方交易
7.4.10.2 关联方交易

7.4.11 关联方交易
7.4.11.1 关联方交易
7.4.11.2 关联方交易

7.4.12 关联方交易
7.4.12.1 关联方交易
7.4.12.2 关联方交易

7.4.13 关联方交易
7.4.13.1 关联方交易
7.4.13.2 关联方交易

7.4.14 关联方交易
7.4.14.1 关联方交易
7.4.14.2 关联方交易

7.4.15 关联方交易
7.4.15.1 关联方交易
7.4.15.2 关联方交易

7.4.16 关联方交易
7.4.16.1 关联方交易
7.4.16.2 关联方交易

7.4.17 关联方交易
7.4.17.1 关联方交易
7.4.17.2 关联方交易

7.4.18 关联方交易
7.4.18.1 关联方交易
7.4.18.2 关联方交易

7.4.19 关联方交易
7.4.19.1 关联方交易
7.4.19.2 关联方交易

7.4.20 关联方交易
7.4.20.1 关联方交易
7.4.20.2 关联方交易

7.4.21 关联方交易
7.4.21.1 关联方交易
7.4.21.2 关联方交易

7.4.22 关联方交易
7.4.22.1 关联方交易
7.4.22.2 关联方交易

7.4.23 关联方交易
7.4.23.1 关联方交易
7.4.23.2 关联方交易

7.4.24 关联方交易
7.4.24.1 关联方交易
7.4.24.2 关联方交易

7.4.25 关联方交易
7.4.25.1 关联方交易
7.4.25.2 关联方交易

7.4.26 关联方交易
7.4.26.1 关联方交易
7.4.26.2 关联方交易

7.4.27 关联方交易
7.4.27.1 关联方交易
7.4.27.2 关联方交易

7.4.28 关联方交易
7.4.28.1 关联方交易
7.4.28.2 关联方交易

7.4.29 关联方交易
7.4.29.1 关联方交易
7.4.29.2 关联方交易

7.4.30 关联方交易
7.4.30.1 关联方交易
7.4.30.2 关联方交易

7.4.31 关联方交易
7.4.31.1 关联方交易
7.4.31.2 关联方交易

7.4.32 关联方交易
7.4.32.1 关联方交易
7.4.32.2 关联方交易

7.4.33 关联方交易
7.4.33.1 关联方交易
7.4.33.2 关联方交易

7.4.34 关联方交易
7.4.34.1 关联方交易
7.4.34.2 关联方交易

7.4.35 关联方交易
7.4.35.1 关联方交易
7.4.35.2 关联方交易

7.4.36 关联方交易
7.4.36.1 关联方交易
7.4.36.2 关联方交易

7.4.37 关联方交易
7.4.37.1 关联方交易
7.4.37.2 关联方交易

7.4.38 关联方交易
7.4.38.1 关联方交易
7.4.38.2 关联方交易

7.4.39 关联方交易
7.4.39.1 关联方交易
7.4.39.2 关联方交易

7.4.40 关联方交易
7.4.40.1 关联方交易
7.4.40.2 关联方交易

7.4.41 关联方交易
7.4.41.1 关联方交易
7.4.41.2 关联方交易

7.4.42 关联方交易
7.4.42.1 关联方交易
7.4.42.2 关联方交易

7.4.43 关联方交易
7.4.43.1 关联方交易
7.4.43.2 关联方交易

7.4.44 关联方交易
7.4.44.1 关联方交易
7.4.44.2 关联方交易

7.4.45 关联方交易
7.4.45.1 关联方交易
7.4.45.2 关联方交易

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(%)

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(%)

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

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、基金管理人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。

1.2 基金概况
基金名称:中创400交易型开放式指数证券投资基金
基金代码:000021

1.3 基金管理人
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

1.4 基金托管人
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
基金托管人地址:北京市西城区复兴门内大街26号

1.5 基金投资目标
本基金为股票型基金,追求长期资本增值,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。

1.6 基金投资策略
本基金采用完全复制法,即按照标的指数的成份股及其权重构建跟踪投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

1.7 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:中创400指数收益率

1.8 基金风险收益特征
本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

1.9 基金费用
基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规及基金合同的约定,从基金财产中支付基金管理人报酬和基金托管人报酬。

1.10 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资。

1.11 基金信息披露
基金管理人应当按照相关法律法规及基金合同的约定,及时、准确、完整地披露基金信息。

1.12 基金合同生效
本基金合同于2012年3月22日正式生效。

1.13 基金合同终止
本基金合同终止的条件按照基金合同的约定执行。

1.14 基金合同变更
本基金合同变更的条件按照基金合同的约定执行。

1.15 基金合同修订
本基金合同修订的条件按照基金合同的约定执行。

1.16 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.17 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.18 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.19 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.20 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.21 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.22 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.23 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.24 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.25 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.26 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.27 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.28 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.29 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.30 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.31 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.32 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.33 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.34 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.35 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.36 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.37 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.38 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.39 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.40 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.41 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.42 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.43 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.44 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。

1.45 基金合同其他
本基金合同其他条款按照基金合同的约定执行。