

嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

等部门负责人组成,负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内,固收收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员,基金经理兼任估值专业委员会会议,但不介入基金日常估值业务;参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所,中国证券登记结算有限责任公司,中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
根据本基金基金合同十八(二)“1.在收益评价日,基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率。截至收益评价日基金净值增长率减去标的指数增长率的差额超过1%时,基金管理人可以进行收益分配”。

本期(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年6月30日),本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年6月30日
报告期内基金累计支付的管理费	109,209.55	672,193.84

注:支付基金托管人中国建设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。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本期(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年6月30日),本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本期(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年6月30日),基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年2月6日至2013年6月30日
持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额占基金总份额的比例
嘉实中证500ETF	16,915,804.00	32.42%
	16,915,804.00	25.93%

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,584,685.53	5,862.20	3,821,411.28	373,750.15

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
本期(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年6月30日),本基金未在本承销期间参与认购关联方承销的证券。

6.4.5 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本期(2014年6月30日),本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的处于转股期可转换债券情况
单位:人民币元

股票代码	债券简称	债券期限	债券到期日	债券面值	债券数量	债券公允价值	债券公允价值占基金资产净值的比例	备注
600418	江淮汽车	2014年12月15日	2014年12月15日	10.20	11.22	96.250	815,574.84	981,750.00
002252	上海家化	2014年12月15日	2014年12月15日	63.30	未知	11.160	335,882.84	706,428.00
002340	格林美	2014年12月15日	2014年12月15日	11.19	2014年12月15日	11.77	58,430	597,263.43
000726	广汇矿业	2014年12月15日	2014年12月15日	10.54	2014年12月15日	11.59	50,786	618,606.81
601012	隆基股份	2014年12月15日	2014年12月15日	15.50	2014年12月15日	15.60	34,400	458,266.52
600755	厦门国贸	2014年12月15日	2014年12月15日	4.85	2014年12月15日	4.74	100,960	459,418.32
600409	蔚能	2014年12月15日	2014年12月15日	6.11	2014年12月15日	6.11	78,850	531,505.51
002166	东方材料	2014年12月15日	2014年12月15日	11.39	2014年12月15日	11.10	37,925	428,187.32
600059	古井贡酒	2014年12月15日	2014年12月15日	7.97	2014年12月15日	7.83	53,130	528,661.73
60058	天地科技	2014年12月15日	2014年12月15日	7.97	未知	未知	51,600	463,683.19
000688	广汇股份	2014年12月15日	2014年12月15日	17.13	未知	未知	23,455	310,822.83
000612	焦作万方	2014年12月15日	2014年12月15日	6.08	2014年12月15日	6.69	61,611	361,951.73
600757	长江传媒	2014年12月15日	2014年12月15日	8.85	未知	未知	39,416	278,111.48
600864	哈投股份	2014年12月15日	2014年12月15日	8.68	2014年12月15日	8.30	35,535	263,937.53
002551	德众	2014年12月15日	2014年12月15日	34.01	未知	未知	8,900	295,259.00
600626	凯诺特	2014年12月15日	2014年12月15日	6.59	未知	未知	45,718	408,748.26
002638	宏川	2014年12月15日	2014年12月15日	14.15	2014年12月15日	14.75	20,281	257,391.39
00085	江铃汽车	2014年12月15日	2014年12月15日	15.80	未知	未知	17,481	269,474.92
00263	宏川	2014年12月15日	2014年12月15日	31.99	2014年12月15日	35.19	7,681	348,946.59
60177	力帆股份	2014年12月15日	2014年12月15日	6.39	2014年12月15日	6.70	32,559	213,100.47
60058	安泰电	2014年12月15日	2014年12月15日	19.56	2014年12月15日	21.52	10,000	216,754.82
60050	方得	2014年12月15日	2014年12月15日	3.16	2014年12月15日	3.03	56,864	179,600.24

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购
本期(2014年6月30日),本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购
本期(2014年6月30日),本基金无交易所市场债券正回购余额。

7.1 期末基金资产组合情况
单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例
1	权益投资	204,556,718.88	99.21
2	固定收益投资	204,556,718.88	99.21
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	1,595,105.62	0.77
7	其他各项资产	34,298.31	0.02
合计		206,186,122.81	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
7.2.1 期末按股票投资行业分类的股票投资组合
单位:人民币元

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例
A	农、林、牧、渔业	3,330,973.76	1.63
B	矿业	6,213,668.08	3.07
C	制造业	125,092,724.66	61.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,941,485.73	2.89
E	建筑业	5,539,204.14	2.69
F	批发和零售业	13,649,682.26	6.63
G	交通运输、仓储和邮政业	5,748,123.24	2.79
H	住宿和餐饮业	313,431.00	0.15
I	信息技术、软件和信息技术服务业	10,362,336.74	5.03
J	金融业	2,561,077.30	1.24
K	房地产业	1,571,319.92	0.76
L	租赁和商务服务业	31,931,132.12	15.46
M	科学研究和技术服务业	830,391.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	1,463,809.15	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社公工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	2,562,693.03	1.25
S	综合	1,571,802.01	0.67
合计		204,556,718.88	99.39

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有积极投资股票组合

7.3 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
7.3.1 期末按积极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
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值的比例
1	600570	恒生电子	53,063	1,560,052.20	0.76
2	600587	新华医疗	15,100	1,125,705.00	0.55
3	002190	成飞集成	18,339	1,082,001.00	0.53
4	600557	康缘药业	37,469	1,075,360.30	0.52
5	600659	万向钱潮	102,879	1,057,596.12	0.51
6	600879	航天电子	89,271	1,052,798.38	0.51
7	600698	隆平高科	37,623	1,033,880.94	0.50
8	600312	平高电气	72,589	1,025,830.66	0.50
9	600418	江淮汽车	96,250	881,750.00	0.48
10	002022	科华生物	42,252	973,008.60	0.47

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(www.jsfund.cn)的半年度报告正文。

7.3.2 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
7.3.3 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
7.4 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.4.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有积极投资股票组合

7.3 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
7.3.1 期末按积极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
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值的比例
1	600570	恒生电子	53,063	1,560,052.20	0.76
2	600587	新华医疗	15,100	1,125,705.00	0.55
3	002190	成飞集成	18,339	1,082,001.00	0.53
4	600557	康缘药业	37,469	1,075,360.30	0.52
5	600659	万向钱潮	102,879	1,057,596.12	0.51
6	600879	航天电子	89,271	1,052,798.38	0.51
7	600698	隆平高科	37,623	1,033,880.94	0.50
8	600312	平高电气	72,589	1,025,830.66	0.50
9	600418	江淮汽车	96,250	881,750.00	0.48
10	002022	科华生物	42,252	973,008.60	0.47

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(www.jsfund.cn)的半年度报告正文。

7.3.2 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
7.3.3 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
7.4 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.4.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有积极投资股票组合

7.3 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
7.3.1 期末按积极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
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值的比例
1	600570	恒生电子	53,063	1,560,052.20	0.76
2	600587	新华医疗	15,100	1,125,705.00	0.55
3	002190	成飞集成	18,339	1,082,001.00	0.53
4	600557	康缘药业	37,469	1,075,360.30	0.52
5	600659	万向钱潮	102,879	1,057,596.12	0.51
6	600879	航天电子	89,271	1,052,798.38	0.51
7	600698	隆平高科	37,623	1,033,880.94	0.50
8	600312	平高电气	72,589	1,025,830.66	0.50
9	600418	江淮汽车	96,250	881,750.00	0.48
10	002022	科华生物	42,252	973,008.60	0.47

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(www.jsfund.cn)的半年度报告正文。

7.3.2 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
7.3.3 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
7.4 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.4.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有积极投资股票组合

7.3 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
7.3.1 期末按积极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
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值的比例
1	600570	恒生电子	53,063	1,560,052.20	0.76
2	600587	新华医疗	15,100	1,125,705.00	0.55
3	002190	成飞集成	18,339	1,082,001.00	0.53
4	600557	康缘药业	37,469	1,075,360.30	0.52
5	600659	万向钱潮	102,879	1,057,596.12	0.51
6	600879	航天电子	89,271	1,052,798.38	0.51
7	600698	隆平高科	37,623	1,033,880.94	0.50
8	600312	平高电气	72,589	1,025,830.66	0.50
9	600418	江淮汽车	96,250	881,750.00	0.48
10	002022	科华生物	42,252	973,008.60	0.47

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(www.jsfund.cn)的半年度报告正文。

7.3.2 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
7.3.3 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
7.4 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.4.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有积极投资股票组合

7.3 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
7.3.1 期末按积极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
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值的比例
1	600570	恒生电子	53,063	1,560,052.20	0.76
2	600587	新华医疗	15,100	1,125,705.00	0.55
3	002190	成飞集成	18,339	1,082,001.00	0.53
4	600557	康缘药业	37,469	1,075,360.30	0.52
5	600659	万向钱潮	102,879	1,057,596.12	0.51
6	600879	航天电子	89,271	1,052,798.38	0.51
7	600698	隆平高科	37,623	1,033,880.94	0.50
8	600312	平高电气	72,589	1,025,830.66	0.50
9	600418	江淮汽车	96,250	881,750.00	0.48
10	002022	科华生物	42,252	973,008.60	0.47

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(www.jsfund.cn)的半年度报告正文。

7.3.2 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
7.3.3 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
7.4 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.4.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有积极投资股票组合

7.3 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
7.3.1 期末按积极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
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值的比例
1	600570	恒生电子	53,063	1,560,052.20	0.76
2	600587	新华医疗	15,100	1,125,705.00	0.55
3	002190	成飞集成	18,339	1,082,001.00	0.53