

嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 半年度报告摘要

所有投资情况

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

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

截至报告期末,本基金日均跟踪误差为0.02%,年度化拟合偏差度为0.36%,符合基金合同约定的日均跟踪误差

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1.1177元;本报告期基金份额净值增长率为2.13%,业绩比较基准

4.5 管理人对外宏观经济、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

4.6 管理人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

本基金管理人设立估值专业委员会,委员由固定收益、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人

4.7 管理人报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内,本基金管理人实施利润分配,符合基金合同的约定。

5.1 报告期内本基金托管人遵守信情况的说明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等相关信息的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告

6.1 资产负债表

会计主体:嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产 附注号 本期末 2014年6月30日 上年度末 2013年12月31日

货币存款 6.4.7.1 4,300,043.13 4,964,703.20

结算备付金 15,318.48 35,516.11

存出保证金 14,513.45 17,474.61

交易性金融资产 6.4.7.2 68,584,011.71 64,908,819.37

其中:股票投资 1,868,080.73 4,571.00

基金投资 66,715,930.98 64,904,248.37

债券投资 -- --

资产减值准备 -- --

应收利息 6.4.7.3 921.11 1,035.18

应收股利 -- --

应收申购款 173,829.11 356,016.79

其他资产 6.4.7.6 -- 7,527.76

资产总计 74,519,137.66 74,628,695.66

负债和所有者权益 附注号 本期末 2014年6月30日 上年度末 2013年12月31日

负债: -- --

所有者权益 附注号 本期末 2014年6月30日 上年度末 2013年12月31日

实收资本 6.4.7.1 4,300,043.13 4,964,703.20

未分配利润 6.4.7.2 68,584,011.71 64,908,819.37

所有者权益合计 72,714,077.41 68,461,298.96

负债和所有者权益总计 74,519,137.66 74,628,695.66

注:本基金截至2014年6月30日,基金份额净值1.1177元,基金份额总额65,059,478.95份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目 附注号 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年3月22日至2013年6月30日

一、收入 2,108,848.26 5,966,738.72

1.利息收入 16,671.54 139,811.84

其中:存款利息收入 6.4.7.11 16,671.54 139,811.84

债券利息收入 -- --

资产支持证券利息收入 -- --

买入返售金融资产收入 -- --

其他利息收入 -- --

2.股息收入 1,272,886.95 11,639,437.44

其中:股票股息收入 6.4.7.12 1,448,957.77 1,745,309.28

基金投资收益 6.4.7.13 1,406,891.14 9,739,151.24

资产支持证券投资收益 -- --

贵金属投资收益 -- --

衍生工具收益 6.4.7.15 -- 155,076.92

股利收益 6.4.7.16 12,953.58 --

3.公允价值变动收益 6.4.7.17 742,043.29 -6,121,373.21

4.汇兑收益 -- --

5.其他收入 6.4.7.18 77,246.50 308,862.45

减:二、费用 639,019.24

1.管理人费 14,646.05 136,083.45

2.销售费 2,803.69 27,216.69

3.销售服务费 -- --

4.交易费 6.4.7.19 63,781.75 630,047.65

5.其他支出 -- --

其中:卖出回购金融资产支出 -- --

6.其他费用 6.4.7.20 190,779.15 46,714.45

三、利润总额 1,856,925.04 5,126,819.48

减:所得税费用 -- --

四、净利润 1,856,925.04 5,126,819.48

注:本基金基金合同生效日为2013年3月22日,上年度可比期间为2013年3月22日至2013年6月30日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目 附注号 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年3月22日至2013年6月30日

一、期初所有者权益(基金净值) 62,556,323.84 5,995,975.12 68,461,298.96

二、本期损益产生的基金净值变动数(本期利润) -1,836,925.04 5,126,819.48

三、本期基金净值变动产生的基金净值变动数(本期净值变动) -197,531,669.73 -10,723,887.58 -208,255,757.31

四、1.基金申购款 36,945,478.79 1,875,947.56 38,821,422.26

2.基金赎回款 -55,780,264.42 -6,097,633.38 -62,477,897.80

五、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 -- --

六、期末所有者权益(基金净值) 65,059,478.95 7,654,598.46 72,714,077.41

注:本基金基金合同生效日为2013年3月22日,上年度可比期间为2013年3月22日至2013年6月30日。

6.4 本报告期末

6.4.1 本报告期末采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致的说明

6.4.2 本报告期末采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

6.4.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称 与本基金的关系

嘉实基金管理有限公司 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) 基金托管人、基金代销机构

嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金(“嘉实中证500ETF”) 本基金是该基金的联接基金

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

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3月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 2013年3月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费 14,468.65 136,083.45

其中:支付销售机构的客户维护费 66,745.01 181,642.75

注:1.本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.5%年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=(前一日基金资产净值-基金财产中目标ETF份额所对应资产净值)(若为负数,则取0)×0.5%/当年天数。

注:2.根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议,客户维护费按照代销机构所代销基金的规模有量作为基数进行计算。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 2013年3月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费 2,893.69 27,216.69

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。支付基金管理人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.1%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-基金财产中目标ETF份额所对应资产净值)(若为负数,则取0)×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合同/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3月22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合同/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3月22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。

6.4.10.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末(2014年6月30日)及上年度末(2013年12月31日),其他关联方未持有本基金。

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 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 2013年3月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日

中国建设银行 4,300,043.13 15,870.08 4,782,055.02 134,589.57

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3月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日),本基金未在承销期间内参与认购关联方承销的情况。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

报告期末(2014年6月30日),本基金持有16,915,804.00份目标ETF基金份额(2013年12月31日:16,915,804.00份),占其总份额的比例为32.42%(2013年12月31日:25.93%)。

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 因认购受限/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受限/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

单位:人民币元

股票代码 股票名称 停牌日期 停牌原因 期末 估值比例 复牌日期 复牌 开盘价 数量(股) 期末 公允价值 期末 估值比例 备注

00255 1 海普 2014 2014 34.01 未知 未知 400 13,381.51 13,604.00 -

60101 2 瑞泰 2014 2014 15.50 2014 15.60 600 8,517.00 9,300.00 -

00234 3 格林 2014 2014 11.19 2014 11.77 800 8,892.82 8,952.00 -

60041 4 江淮 2014 2014 10.20 2014 11.22 800 8,160.00 8,160.00 -

60026 5 宏达 2014 2014 6.59 未知 未知 1,100 7,468.65 7,249.00 -

60005 6 吉林 2014 2014 7.97 2014 7.83 850 6,568.29 6,774.50 -

00263 7 佑达 2014 2014 31.99 2014 35.19 200 6,099.00 6,398.00 -

60058 8 马陆 2014 2014 7.97 未知 未知 800 6,583.00 6,376.00 -

60075 9 长江 2014 2014 8.85 未知 未知 600 5,191.15 5,310.00 -

60049 10 顺发 2014 2014 6.11 2014 6.11 800 4,888.00 4,888.00 -

00085 11 宏达 2014 2014 15.80 未知 未知 300 4,621.31 4,740.00 -

60177 12 力帆 2014 2014 8.39 2014 6.70 700 4,642.99 4,473.00 -

00263 13 宏达 2014 2014 14.15 2014 14.75 300 3,993.05 4,245.00 -

00076 14 华力 2014 2014 10.54 2014 11.59 400 4,216.00 4,216.00 -

60061 15 广联 2014 2014 6.08 2014 6.69 600 3,648.00 3,648.00 -

60058 16 广联 2014 2014 17.15 未知 未知 200 2,428.00 3,426.00 -

60050 17 方正 2014 2014 3.16 2014 3.03 300 2,846.83 2,844.00 -

60086 18 哈投 2014 2014 6.68 2014 8.30 300 2,604.00 2,604.00 -

60075 19 厦门 2014 2014 4.85 2014 4.74 500 2,523.57 2,425.00 -

60085 20 宇光 2014 2014 19.56 2014 21.52 100 1,956.00 1,956.00 -

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

本期末(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

本期末(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 投资组合 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)

1 权益投资 1,868,080.73 2.51

2 债券投资 1,364,068.04 1.89

3 基金投资 66,715,930.98 89.53

4 固定收益投资 -- --

5 其他资产 -- --

6 其他资产 -- --

7 其他资产 -- --

8 其他资产 -- --

9 其他资产 -- --

10 其他资产 -- --

11 其他资产 -- --

12 其他资产 -- --

13 其他资产 -- --

14 其他资产 -- --

15 其他资产 -- --

16 其他资产 -- --