# 嘉实增长开放式证券投资基金

## 【2014】第三季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月21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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一,嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成,包括相互独立的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金。每只基金均为契约型开放式,适用一个基金合同和招募说明书。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 嘉实增长混合 |
| 基金主代码 | 070002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2003年7月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 535,489,137.11份 |
| 投资目标 | 投资于具有高速成长潜力的中小企业上市公司,以获取未来资本增值的机会,并谋求基金资产的中长期稳定增值,同时通过分散投资提高基金资产的流动性。 |
| 投资策略 | 从公司基本面分析入手挑选具有成长潜力的股票,重点投资于预期利润或收入具有良好增长潜力的成长型上市公司的股票。投资组合比例范围为股票40%-75%,债券20%-55%,现金5%左右。 |
| 业绩比较基准 | 巨潮500(小盘)指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属于中高风险证券投资基金,长期系统性风险控制目标为基金份额净值相对于基金业绩基准的β值保持在0.5至0.8之间。 |
| 基金管理人 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

§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(2014年7月1日 - 2014年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 146,385,704.21 |
| 2.本期利润 | 361,473,494.19 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.6369 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,140,685,752.60 |
| 5.期末基金份额净值 | 5.865 |

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 | 12.46% | 0.74% | 25.60% | 0.94% | -13.14% | -0.20% |

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

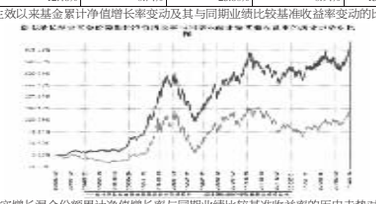

图:嘉实增长混合份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2003年7月9日至2014年9月30日)

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同第三部分(四(一)投资范围和(四)各基金投资组合比例限制)的规定:(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%;(2)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;(3)本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;(4)投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%;(5)本基金的股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

§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 | | |
| 邵健 | 本基金基金经理,公司副总经理 | 2004年4月6日 | - | 16年 | 曾任职于国泰君安证券研究所,历任研究员、行业投资策略组组长、行业公司部副经理,从事行业研究、行业比较研究及资产配置等工作。2003年7月加盟嘉实基金,经济学硕士,具有基金从业资格,中国国籍。 |

注:(1)任职日期、离任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、《嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券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

3季度,中国宏观经济虽有所走弱,但A股市场依然保持了强势向上,主要是几方面的因素促成:一、对转型与未来改革的期待,引发了新兴产业的持续上涨;二、大量外部资产证券化的预期;三、大类资产风险收益比变化引发持续的资金流入;四、沪港通等引发的资金流入预期。在市场显著上涨的背景下,大盘股与小盘股在三季度均有上涨,季度初在沪港通预期下,大盘股显著上涨,但中小盘股在后期迅速赶超。行业方面呈现出普涨行情,国防军工、农业、纺织服装、交通运输等行业相对表现较优,主题投资表现突出:低价重组、军工题材、卫星导航、土地改革等主题表现突出。

在三季度中,本基金保持了仓位的稳定。行业与主题方面,我们保持了计算机、互联网、传媒、新材料等未来空间较大的行业的投资,与此同时,增加了装饰、新能源汽车等行业的投资,并增加了沪港通以及国企改革主题的配置,取得了良好的效果。

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5.865元;本报告期基金份额净值增长率为12.46%,业绩比较基准收益率为25.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们认为中国经济增速虽然趋于下降,但非银行企业的盈利可能保持良好,与此同时,政府正在致力于降低实体经济的成本与金融的风险,这些都是重要的长期因素。在结构方面,大小盘股均有一定的长期机会,大盘股主要依赖于国企的改革及未来中国资本市场的进一步对外开放,而中小盘股主要受益于中国的转型。在未来的行业主题方面,我们认为互联网、文化体育传媒、新能源新材、医药生物、先进制造、军工、资产证券化与国企改革等,都是我们关注的领域。在市场热度较高的中小盘股方面,我们预期未来会出现高度分化,只有那些长期空间较大,估值有吸引力的公司才能最终带给投资者收益。在这种背景下,我们将进一步努力发掘具备巨大成长空间与良好估值吸引力的细分行业和龙头个股,力争继续为投资人获取良好的回报。

§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 | 2,174,894,512.45 | 68.85 |
| | 其中:股票 | 2,174,894,512.45 | 68.85 |
| 2 | 固定收益投资 | 669,384,932.00 | 21.19 |
| | 其中:债券 | 669,384,932.00 | 21.19 |
| | 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 | 133,324,370.91 | 4.22 |
| 7 | 其他资产 | 181,225,333.68 | 5.74 |
| | 合计 | 3,158,829,149.04 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 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 | 985,972,593.05 | 31.39 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 120,629.67 | - |
| E | 建筑业 | 144,157,407.58 | 4.59 |
| F | 批发和零售业 | 118,738,608.50 | 3.78 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 52,374,594.34 | 1.67 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 805,347,273.50 | 25.64 |
| J | 金融业 | 1,625,501.22 | 0.05 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,310,938.00 | 0.11 |
| 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 | 3,410,497.00 | 0.11 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 57,585,602.69 | 1.83 |
| S | 综合 | 2,250,866.90 | 0.07 |
| | 合计 | 2,174,894,512.45 | 69.25 |

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 | 002450 | 康得新 | 8,180,263 | 254,569,784.56 | 8.11 |
| 2 | 600570 | 恒生电子 | 4,455,024 | 187,912,912.32 | 5.98 |
| 3 | 002439 | 启明星辰 | 7,081,588 | 171,374,429.60 | 5.46 |
| 4 | 300104 | 乐视网 | 3,348,570 | 125,203,032.30 | 3.99 |
| 5 | 002081 | 金螳螂 | 5,244,478 | 101,585,538.86 | 3.23 |
| 6 | 300369 | 绿盟科技 | 1,206,845 | 93,687,377.35 | 2.98 |
| 7 | 300113 | 顺网科技 | 3,049,299 | 90,564,180.30 | 2.88 |
| 8 | 600525 | 长园集团 | 5,847,656 | 79,060,309.12 | 2.52 |
| 9 | 000028 | 国药一致 | 1,430,634 | 73,963,777.80 | 2.36 |
| 10 | 300168 | 万达信息 | 2,524,718 | 69,682,216.80 | 2.22 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 658,904,000.00 | 20.98 |
| | 其中:政策性金融债 | 658,904,000.00 | 20.98 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 10,480,932.00 | 0.33 |
| 8 | 其他 | - | - |
| | 合计 | 669,384,932.00 | 21.31 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 120215 | 12国开15 | 2,100,000 | 209,517,000.00 | 6.67 |
| 2 | 120212 | 12国开12 | 1,200,000 | 119,568,000.00 | 3.81 |
| 3 | 140437 | 14农发37 | 1,000,000 | 99,880,000.00 | 3.18 |
| 4 | 130243 | 13国开43 | 600,000 | 60,030,000.00 | 1.91 |
| 5 | 140207 | 14国开07 | 500,000 | 50,115,000.00 | 1.60 |

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 | 358,210.41 |
| 2 | 应收证券清算款 | 165,581,617.96 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 13,679,500.40 |
| 5 | 应收申购款 | 1,606,004.91 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 181,225,333.68 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113005 | 平安转债 | 10,480,932.00 | 0.33 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 序号 | 590,554,411.96 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 14,118,758.36 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 69,184,033.21 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 535,489,137.11 |

注:报告期期间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
2014年10月24日

# 中创400交易型开放式指数证券投资基金

## 【2014】第三季度报告

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:2014年10月24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2014年10月21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2014年7月1日起至2014年9月30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 | 107,561,264.00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(2014年7月1日 - 2014年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 2,498,659.01 |
| 2.本期利润 | 29,014,170.34 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2997 |
| 4.期末基金资产净值 | 179,089,968.39 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.6650 |

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 | 21.86% | 1.02% | 22.17% | 1.02% | -0.31% | 0.00% |

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

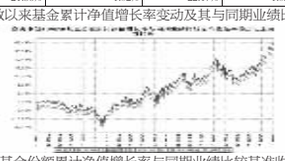

图:嘉实中创400ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年3月22日至2014年9月30日)

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。

§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联接、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基金经理 | 2014年5月9日 | - | 8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、离任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、《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

本报告期内,本基金日均跟踪误差为0.03%,年度化拟合偏离度为0.52%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.2%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1.6650元;本报告期基金份额净值增长率为21.86%,业绩比较基准收益率为22.17%。

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中创400指数的被动投资管理产品,我们将继续秉承指数化被动投资策略,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,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。

§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 | 177,915,967.37 | 98.99 |
| | 其中:股票 | 177,915,967.37 | 98.99 |
| 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 | 1,791,580.77 | 1.00 |
| 7 | 其他资产 | 17,935.30 | 0.01 |
| | 合计 | 179,725,483.44 | 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

| 序号 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,363,117.86 | 0.76 |
| B | 采矿业 | 2,971,974.40 | 1.66 |
| C | 制造业 | 129,381,164.94 | 72.24 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 968,772.27 | 0.54 |
| E | 建筑业 | 5,029,003.06 | 2.81 |
| F | 批发和零售业 | 4,449,011.02 | 2.48 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 491,683.30 | 0.27 |
| H | 住宿和餐饮业 | 1,242,891.68 | 0.69 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 20,371,315.28 | 11.37 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 1,188,106.40 | 0.66 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,694,762.75 | 0.95 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,620,257.34 | 1.46 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,888,815.18 | 1.61 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,803,041.50 | 1.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,446,631.24 | 0.81 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 177,910,548.22 | 99.34 |

5.2.2 报告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。

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 | 300168 | 万达信息 | 44,096 | 1,217,049.60 | 0.68 |
| 2 | 300147 | 香雪制药 | 46,943 | 1,065,136.67 | 0.59 |
| 3 | 002266 | 浙富控股 | 143,852 | 1,058,750.72 | 0.59 |
| 4 | 300026 | 红日药业 | 36,013 | 1,056,261.29 | 0.59 |
| 5 | 002049 | 同方国芯 | 31,216 | 1,055,725.12 | 0.59 |
| 6 | 300273 | 和佳股份 | 43,863 | 1,003,146.81 | 0.56 |
| 7 | 300202 | 聚龙股份 | 32,700 | 927,372.00 | 0.52 |
| 8 | 300077 | 国民技术 | 30,998 | 920,640.60 | 0.51 |
| 9 | 002153 | 石基信息 | 13,098 | 919,086.66 | 0.51 |
| 10 | 002440 | 闰土股份 | 48,592 | 883,402.56 | 0.49 |

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
报告期末,本基金未持有积极投资股票。

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 报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况的说明
报告期末,本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

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
报告期末,本基金未持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 95,561,264.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 15,000,000.00 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 3,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 107,561,264.00 |

§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
2014年10月24日

# 嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 【2014】第三季度报告

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:2014年10月24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2014年10月21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2014年7月1日起至2014年9月30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 |
| 交易代码 | 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 | 112,269,730.94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

| 投资目标 | 报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 1,430,561.18 |
| 2.本期利润 | 27,696,536.08 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2762 |
| 4.期末基金资产净值 | 182,048,780.95 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.6215 |

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 | 20.51% | 0.96% | 20.98% | 0.96% | -0.47% | 0.00% |

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

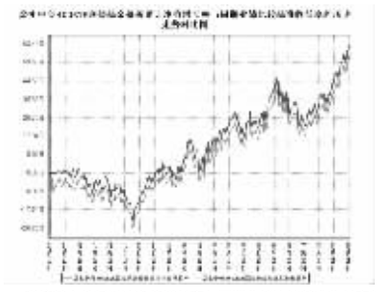

图:嘉实中创400ETF联接基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年3月22日至2014年9月30日)

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基金经理 | 2014年5月9日 | - | 8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、离任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