



# 中创400交易型开放式指数证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

(2018年第1号)

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

中创400交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金或基金”）根据2012年1月6日中国证券监督管理委员会《关于核准中创400交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可[2012]13号）核准进行募集。本基金基金合同于2012年3月22日起生效，自该日起基金管理人正式开始管理本基金。

### 重要提示

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人承诺以恪尽职守、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，也不向投资者保证最低收益。

本摘要所载内容截止日为2018年3月22日（特别事项注明截止日除外），有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日。



## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

#### 1. 基本情况

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	赵学军
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司40%，德意志资产管理（亚洲）有限公司30%，立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	(010) 65215588
传真	(010) 65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

### (二) 主要人员情况

#### 1. 基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

牛成立先生，联席董事长，经济学硕士，中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机  
构监管司副处长、处长；中国银行厦门分行党委委员、副行长（挂职）；中国银行业监督管理委员会（下称银监会）非银行金融机构监管部处长；银监会新疆监管局党委委员、副局长；  
银监会银行监管四部副主任；银监会黑龙江监管局党委书记、局长；银监会融资性担保业务  
工作部（融资性担保业务监管部际联席会议办公室）主任；中诚信托有限责任公司党委委员、  
总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长，兼任中国信托业保障基金有限责任公  
司董事。

赵学军先生，董事长，党委书记，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司电视设计  
所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货  
经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至2017年12  
月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。



朱蕾女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任保监会财会部资金运用处主任科员；国都证券有限责任公司研究部高级经理；中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略官；现任中诚信托有限责任公司总裁助理兼国际业务部总经理；兼任中诚国际资本有限公司总经理、深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、总经理。

高峰先生，董事，美国籍，美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁，美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自 1996 年加入德意志银行以来，曾任德意志银行（纽约、香港、新加坡）董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长，2008 年至今任德意志银行（中国）有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

Jonathan Paul Eilbeck 先生，董事，英国籍，南安普顿大学学士学位。曾任 Sena Consulting 公司咨询顾问，JP Morgan 固定收益亚太区 CFO、COO，JP Morgan Chase 固定收益亚太区 CFO、COO，德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008 年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

韩家乐先生，董事。1990 年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990 年 2 月至 2000 年 5 月任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994 年至今，任北京德恒有限责任公司总经理；2001 年 11 月至今，任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004 至今任万盟并购集团董事长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编，汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任上海证券交易所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会主任。

王瑞华先生，独立董事，管理学博士，会计学教授，注册会计师，中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生部副主任。2012 年 12 月起担任中央财经大学商学院院长兼 MBA 教育中心主任。

张树忠先生，监事长，经济学博士，高级经济师，中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理；光大证券公司总裁助理、北方总部总经理、资产管理总监；光大保德信基金管理公司董事、副总经理；大通证券股份有限公司副总经理、总经理；大成基金管理有限公司董事长，中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官；中诚信托有限责任公司副董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁，



兼任中诚资本管理（北京）有限公司董事长。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

龚康先生，监事，中共党员，博士研究生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部，历任人力资源高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

经雷先生，总经理，金融学、会计学专业本科学历，工商管理学学士学位，特许金融分析师（CFA）。1998年到2008在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部担任研究投资工作。2008年到2013年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监，首席投资总监及资产管理中心负责人。2013年10月至今就职于嘉实基金管理有限公司，历任董事总经理（MD）、机构投资和固定收益业务首席投资官，现兼任公司固定收益业务首席投资官。

宋振茹女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理公司，历任督察员和公司副总经理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

邵健先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券行业研究员，国泰君安证券行业研究部副经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监，南方证券金通证券部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金管理有限公司总经理助理。

## 2、基金经理

### （1）现任基金经理

陈正宪先生，硕士研究生，13年证券从业经历。曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008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执行总监及基金经理。2016年1月5日至今担任嘉实中证500ETF、



嘉实中证 500ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实 H 股指数(QDII-LOF)基金经理,2017 年 6 月 7 日至今任嘉实嘉实中关村 A 股 ETF 基金经理,2017 年 6 月 29 日至今任嘉实富时中国 A50ETF 联接基金经理,2017 年 7 月 3 日至今任嘉实富时中国 A50ETF 基金经理,2017 年 7 月 15 日至今任嘉实创业板 ETF 基金经理。2016 年 3 月 24 日至今担任嘉实基本面 50 指数(LOF)、嘉实中创 400ETF 联接及本基金基金经理。

刘珈吟女士,硕士研究生,8 年证券从业经历。2009 年加入嘉实基金管理有限公司,任指数投资部指数研究员一职,现任指数投资部基金经理。2016 年 3 月 24 日至今担任嘉实中创 400ETF 联接、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF 基金经理。2017 年 6 月 7 日至今任嘉实中关村 A 股 ETF 基金经理。2016 年 3 月 24 日至今任本基金基金经理

### (2) 历任基金经理

2012 年 3 月 22 日至 2014 年 5 月 9 日,杨宇先生任本基金基金经理。

2014 年 5 月 9 日至 2016 年 3 月 24 日,何如女士任本基金基金经理。

### 3、股票投资决策委员会

股票投资决策委员会的成员包括:公司副总经理兼股票投资业务联席 CIO 邵健先生,公司总经理经雷先生,股票投资业务联席 CIO 兼研究总监陈少平女士,助理 CIO 兼股票投资部总监邵秋涛先生,人工智能投资部负责人张自力先生,资深基金经理胡涛先生、张金涛先生和谭丽女士。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一) 基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间:1984 年 1 月 1 日

法定代表人:易会满

注册资本:人民币 35,640,625.71 万元

联系电话:010-66105799



联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至 2017 年末，中国工商银行资产托管部共有员工 230 人，平均年龄 33 岁，95% 以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2017 年末，中国工商银行共托管证券投资基金 815 只。自 2003 年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 54 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1. 申购赎回代办券商

（1）中信建投证券股份有限公司

住所	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
办公地址	北京市朝阳门内大街 188 号		
法定代表人	王常青	联系人	权唐
电话	(010) 65183880	传真	(010) 65182261
网址	www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

（2）国信证券股份有限公司

注册地址	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
------	---------------------------------



法定代表人	何如	联系人	周杨
电话	0755-82130833	传真	0755-82133952
网址	www.guosen.com.cn	客服电话	95536

(3) 方正证券股份有限公司

住所、办公地址	湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层		
法定代表人	高利	联系人	丁敏
电话	(010)59355997	传真	(010)56437013
网址	www.foundersc.com	客服电话	95571

(4) 中泰证券股份有限公司

住所、办公地址	山东省济南市市中区经七路 86 号		
法定代表人	李玮	联系人	许曼华
电话	021-20315290		
网址	www.zts.com.cn	客服电话	95538

2. 二级市场交易代办证券公司

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

(二) 注册登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
住所、办公地址	北京市西城区太平桥大街17号		
法定代表人	金颖	联系人	丁志勇
电话	(010) 59378982	传真	(010) 58598907

(三) 律师事务所和经办律师

名称	上海市通力律师事务所		
住所、办公地址	上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	(021) 31358666	传真	(021) 31358600
经办律师	吕红、黎明		

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）		
----	----------------------	--	--



住所	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼		
办公地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼		
法定代表人	李丹	联系人	张勇
电话	(021) 23238888	传真	(021) 23238800
经办注册会计师	薛竟、张勇		

#### 四、基金的名称

本基金名称：中创400交易型开放式指数证券投资基

#### 五、基金的类型

本基金类型：交易型开放式

#### 六、基金的投资目标

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%。

#### 七、基金的投资范围

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 八、基金的投资策略

##### （一）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。但在因特殊情况（如流动性原



因)导致无法获得足够数量的股票时,或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时,基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到跟踪标的指数的目的。

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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的,基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

### 1、决策依据

有关法律、法规、《基金合同》和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

### 2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

### 3、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

(1) 研究:指数投资研究小组依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作,撰写研究报告,作为基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策:投资决策委员会依据指数投资研究小组提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理的日常决策。

(3) 组合构建:根据标的指数相关信息,结合内部指数投资研究,基金经理主要以指数复制法构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当指数投资的方法,以降低投资成本、控制投资风险。

(4) 交易执行:集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5) 投资绩效评估:风险管理部定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。

(6) 组合监控与调整:基金经理将跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监



控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金《招募说明书》及其更新中公告。

## (二) 投资组合管理

### 1、投资组合的建立

为达到紧密跟踪标的指数的投资目标，正常情况下本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金将在《基金合同》生效之日起 3 个月内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。

正常情况下本基金将采用完全复制法，严格按标的指数的个股权重构建投资组合。但在少数特殊情况下基金经理将配合使用其他指数投资技术作为完全复制法的补充，以更好达到复制指数的目标。这些情形包括：1) 由于标的指数成份股发生变动、增发/配股等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化，而由于交易成本、交易制度等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整，需要采用其他指数投资技术保持组合对标的指数的拟合度并降低交易成本；2) 个别成份股流动性严重不足使基金无法买入足够的股票数量，采用其他指数投资技术能较好替代目标成份股的个股构建组合；3) 成份股派发现金股息而基金未进行收益分配可能导致基金组合与指数产生偏离；4) 相关上市公司停牌同时允许现金替代导致基金无法及时买入成份股；5) 其它需要采用非完全复制指数投资技术的情形。

基金管理人构建投资组合的过程主要分为 3 步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

- (1) 确定目标组合：基金管理人主要根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。
- (2) 确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。
- (3) 逐步调整：基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

### 2、每日投资组合管理

(1) 成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为(如：股本变化、分红、停牌、复牌等)信息，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

(2) 标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数编制方法的变化，确定指数变化是否与预



期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

(3) 每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

(4) 组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。

(5) 组合调整：①利用指数投资管理系统，找出将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合交易计划。②如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，应提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略。③调整组合，达到目标组合的持仓结构。

(6) 以 T-1 日指数成份股构成及其权重为基础，考虑 T 日将会发生的上市公司变动等情况，设计 T 日申购赎回清单并公告。

### 3、定期投资组合管理

每月末，根据《基金合同》中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

每半年根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理依据投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少变更成份股带来跟踪误差。

### 4、投资绩效评估

风险管理部门每日提供投资绩效评估报告，基金经理据此分析基金的跟踪偏离情况，分析跟踪误差的产生原因。

## 九、标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数及业绩比较基准为：中创400指数。

## 十、基金的风险收益特征

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。

## 十一、基金投资组合报告

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。

本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 2018 年 1 月 17 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。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 12 月 31 日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

## 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	113,142,410.27	99.21
	其中：股票	113,142,410.27	99.21
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	66,400.00	0.06
	其中：债券	66,400.00	0.06
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	688,410.60	0.60
8	其他资产	140,595.96	0.12
9	合计	114,037,816.83	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### （1）报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,811,549.06	1.59
B	采矿业	1,109,121.39	0.98
C	制造业	74,596,159.82	65.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	691,128.71	0.61
E	建筑业	3,168,917.33	2.79
F	批发和零售业	3,764,352.94	3.31



G	交通运输、仓储和邮政业	1,040,323.08	0.92
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,723,804.14	15.59
J	金融业	412,316.00	0.36
K	房地产业	1,521,496.85	1.34
L	租赁和商务服务业	1,769,126.90	1.56
M	科学研究和技术服务业	797,456.00	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	1,172,654.20	1.03
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	1,603,944.68	1.41
R	文化、体育和娱乐业	1,805,234.06	1.59
S	综合	—	—
	合计	112,987,585.16	99.40

## (2) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	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	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	154,825.11	0.14
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
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	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	154,825.11	0.14

### 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

#### (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	300142	沃森生物	46,540.00	849,355.00	0.75
2	002075	沙钢股份	51,500.00	830,180.00	0.73
3	300015	爱尔眼科	25,962.00	799,629.60	0.70
4	300266	兴源环境	28,900.00	780,300.00	0.69
5	002311	海大集团	33,000.00	772,200.00	0.68
6	300088	长信科技	94,400.00	739,152.00	0.65
7	002185	华天科技	82,296.00	701,161.92	0.62
8	002035	华帝股份	22,100.00	666,094.00	0.59
9	300274	阳光电源	34,940.00	655,823.80	0.58
10	002366	台海核电	24,600.00	650,670.00	0.57

#### (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

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	002504	*ST弘高	24,693	154,825.11	0.14

注:报告期末, 本基金仅持有上述 1 只积极投资股票。

### 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	—	—
	其中: 政策性金融债	—	—



4	企业债券		—	—
5	企业短期融资券		—	—
6	中期票据		—	—
7	可转债（可交换债）	66,400.00		0.06
8	同业存单	—		—
9	其他	—		—
10	合计	66,400.00		0.06

## 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	123004	铁汉转债	309	30,900.00	0.03
2	128029	太阳转债	274	27,400.00	0.02
3	128027	崇达转债	51	5,100.00	0.00
4	123003	蓝思转债	30	3,000.00	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述 4 支债券。

## 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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 11. 投资组合报告附注

**(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。

**(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。

**(3) 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,195.83
2	应收证券清算款	138,247.28
3	应收股利	—
4	应收利息	152.85
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	140,595.96

**(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

**(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****1) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002075	沙钢股份	830,180.00	0.73	重大事项停牌
2	002366	台海核电	650,670.00	0.57	重大事项停牌

**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，本基金积极投资的前五名股票中不存在流通受限情况。

**十二、基金的业绩**

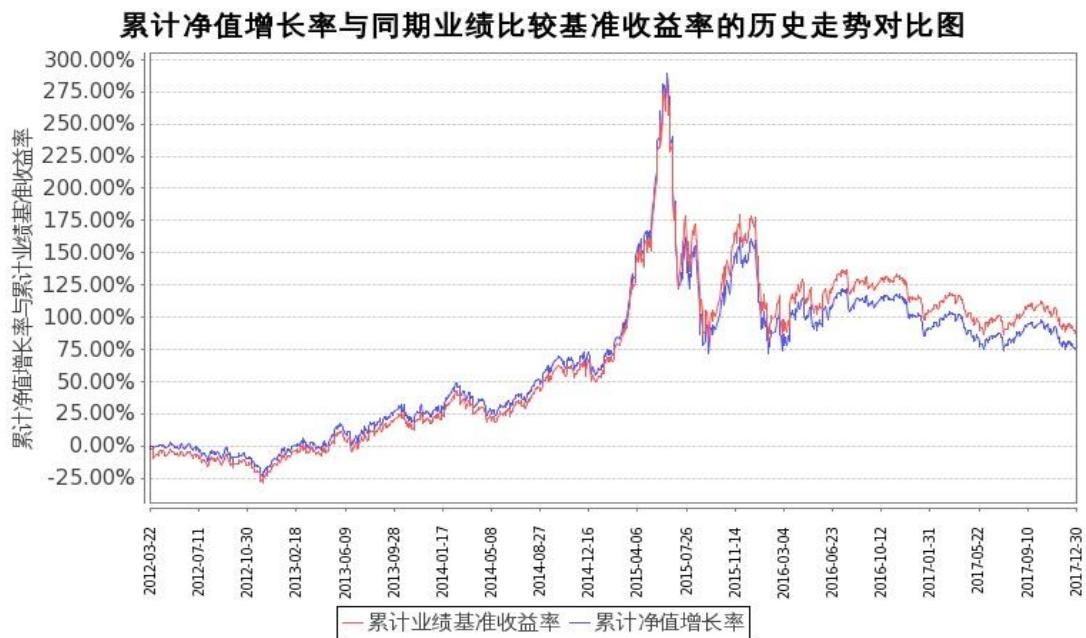
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证

基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

#### 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
2012年3月22日(基金合同生效日)-2012年12月31日	-9.66%	1.34%	-14.20%	1.47%	4.54%	-0.13%
2013年	41.09%	1.60%	42.10%	1.61%	-1.01%	-0.01%
2014年	22.44%	1.39%	23.37%	1.40%	-0.93%	-0.01%
2015年	63.33%	2.76%	81.10%	2.83%	-17.77%	-0.07%
2016年	-21.62%	2.06%	-21.60%	2.07%	-0.02%	-0.01%
2017年	-11.87%	0.97%	-11.12%	0.97%	-0.75%	0.00%

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2017年12月31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。

## 十三、费用概览

### (一) 基金费用的种类

#### 1、与基金运作有关的费用

##### (1) 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日的基金资产净值乘以 0.5%的费率来计算，计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人

##### (2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性收取。

##### (3) 基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用许可费计提方法支付指数使用许可费。其中，《基金合同》生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

在通常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.03%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% / \text{当年天数}$$



H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

《基金合同》生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。

自《基金合同》生效之日所在季度的下一个季度起，指数许可使用许可费的收取下限为每季度 7.5 万元，即不足人民币 7.5 万元则按照 7.5 万元收取。

指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。

如果指数使用许可协议约定的指数使用许可费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用许可费。基金管理人应在《招募说明书》及其更新中披露基金最新适用的方法。

#### （4）与基金运作有关的其他费用

主要包括因基金的证券交易或结算而产生的费用、基金合同生效以后的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金上市费及年费、基金合同生效以后的会计师费和律师费、基金的银行汇划费用等。该等费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

## 2、与基金销售有关的费用

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

### （二）不列入基金费用的项目

（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

（3）《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （三）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金



管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体上公告。

#### （四）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况，对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下：

1. 在“重要提示”部分：明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2. 在“三、基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关信息。
3. 在“四、基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关信息。
4. 在“五、相关服务机构”部分：更新了相关服务机构信息。
5. 在“九、基金份额的申购、赎回”部分：更新了申购赎回清单的示例。
6. 在“十一、基金的投资”部分：增加了本基金最近一期投资组合报告内容。
7. 在“十二、基金的业绩”部分：基金业绩更新至 2017 年 12 月 31 日。
8. 根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及基金管理人 2018 年 3 月 22 日发布的《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同及托管协议的公告》，更新了“基金份额申购、赎回与转换、基金的投资、基金资产的估值、基金的信息披露、风险揭示”等章节的相关内容。

嘉实基金管理有限公司

2018年5月4日