

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:2012年7月18日

1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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的规定，于2012年7月16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。

本报告期中的财务数据未经审计。

2 基金产品概况

基金简称:嘉实深证基本面120ETF(场内简称:深120)

基金主代码:159910

基金运作方式:交易型开放式

基金合同生效日:2011年8月1日

报告期末基金份额总额:558,906,143.00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。

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及其权重进行构建股票投资组合，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:深证基本面120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，具有与标的指数类似的指数组合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:中国银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -52,114.68

2.本期利润 2,458,513.65

3.加权平均基金份额本期利润 0.0047

4.期末基金份额净值 475,332,291.71

5.期末基金资产净值 0.8505

注:1)本报告期期间损益折算后基金份额净值收入、投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益扣除费用和相关费用后的余额,本期利润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申购基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于不计费用。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.03% 0.14% 0.57% 1.18% 0.46% -0.04%

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:嘉实深证基本面120ETF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图

注:1)任一日为基点是指基金合同生效之日;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合规性情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格按照《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实深证基本面120ETF基金合同》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, 不保证基金一定盈利。

本基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告期中的财务数据未经审计。

本报告期(2012年4月1日起至2012年6月30日止)

§ 2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称:嘉实深证基本面120ETF联接

基金主代码:070023

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2011年8月1日

报告期末基金份额总额:445,384,289.08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。

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来实现对业绩比较基准的跟踪。在运作过程中,本基金将在综合考虑合规、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二级市场交易的方式进行对目标ETF的买卖。

业绩比较基准:深证基本面120指数*95%+银行同期存款利率*5%

风险收益特征:本基金为深证基本面120ETF的联接基金,其业绩表现与深证基本面120指数及深证基本面120ETF的走势密切相关,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:中国银行股份有限公司

2.2 制基金基本情况

基金名称:深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金

基金主代码:159910

基金运作方式:交易型开放式

基金合同生效日:2011年8月1日

上市日期:2011年9月27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:中国银行股份有限公司

目标基金投资目标:本基金将被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

目标基金投资策略:本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股及其权重的变动进行相应调整。

目标基金业绩比较基准:深证基本面120指数

目标基金风险收益特征: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,具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§ 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(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -937,896.55

2.本期利润 576,454.76

3.加权平均基金份额本期利润 0.0014

4.期末基金份额净值 394,432,675.85

5.期末基金资产净值 0.8856

注:1)本期实现收益折算后基金份额净值收入、投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益扣除费用和相关费用后的余额,本期利润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申购基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于不计费用。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.98% 1.07% 0.57% 1.12% 0.41% -0.05%

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:嘉实深证基本面120ETF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图

注:1)任一日为基点是指基金合同生效之日;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合规性情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格按照《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实深证基本面120ETF基金合同》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, 不保证基金一定盈利。

本基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告期中的财务数据未经审计。

本报告期(2012年4月1日起至2012年6月30日止)

§ 2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称:嘉实深证基本面120ETF联接

基金主代码:070023

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2011年8月1日

报告期末基金份额总额:445,384,289.08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。

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来实现对业绩比较基准的跟踪。在运作过程中,本基金将在综合考虑合规、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二级市场交易的方式进行对目标ETF的买卖。

业绩比较基准:深证基本面120指数*95%+银行同期存款利率*5%

风险收益特征:本基金为深证基本面120ETF的联接基金,其业绩表现与深证基本面120指数及深证基本面120ETF的走势密切相关,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:中国银行股份有限公司

2.2 制基金基本情况

基金名称:深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金

基金主代码:159910

基金运作方式:交易型开放式

基金合同生效日:2011年8月1日

上市日期:2011年9月27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:中国银行股份有限公司

目标基金投资目标:本基金将被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

目标基金投资策略:本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股及其权重的变动进行相应调整。

目标基金业绩比较基准:深证基本面120指数

目标基金风险收益特征: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。

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(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 12,290,464.13

2.本期利润 31,083,258.96

3.加权平均基金份额本期利润 0.0284

4.期末基金份额净值 1,069,270,517.37

5.期末基金资产净值 1,048

注:1)本期实现收益折算后基金份额净值收入、投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益扣除费用和相关费用后的余额,本期利润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申购基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于不计费用。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.75% 0.18% 1.21% 0.01% 1.54% 0.17%

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:嘉实深证基本面120ETF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图

注:1)任一日为基点是指基金合同生效之日;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合规性情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格按照《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实深证基本面120ETF基金合同》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, 不保证基金一定盈利。

本基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告期中的财务数据未经审计。

本报告期(2012年4月1日起至2012年6月30日止)

§ 2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称:嘉实深证基本面120ETF联接

基金主代码:070023

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2011年8月1日

报告期末基金份额总额:445,384,289.08份