

嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金

2012第四季度报告

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:2013年1月21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2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等各项内容，保证复核结果不存在虚假记载、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。

本报告期初的财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称:嘉实沪深300ETF(场内简称:300ETF)

基金代码:159919

基金运作方式:交易型开放式

基金合同生效日:2012年5月17日

报告期末基金份额总额:16,302,706,477.00份

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

本基金采买全复制法，即按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:本基金的业绩比较基准为沪深300指数。

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金，及货币市场基金。

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水平高于混合型基金、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10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -185,089,429.02

2.本期利润 3,615,224,019.69

3.加权平均基金份额本期利润 0.1156

4.期末基金资产净值 41,132,669,792.31

5.期末基金份额净值 2.5231

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，本期利息收入为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将低于所列数字。

3.2 基金的净值表现

3.2.1 本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(%) 净值增长率(%) 基准收益率(%) 基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 9.94% 1.28% 10.02% 1.28% -0.08% 0.00%

3.2.2 本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

注:本基金合同生效日起12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“十五、投资比例”的有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理或基金经理小组简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

本基金、嘉实中创400ETF、嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF(LOF)基金经理、华富基金管理有限公司产品总监

杨宇 2012年5月7日 - 14年 曾先后担任平安保险投资管理有限公司基金投资部总经理及天同基金管理有限公司投资部总经理、万联(天同)180ETF基金经理、南开大学经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。

本基金、嘉实沪深300ETF(LOF)基金经理、华富基金管理有限公司产品总监

张宏民 2012年5月7日 - 11年 2000年10月加入嘉实基金管理有限公司，在研究院从事定性研究工作，2008年起任公司结构化产品投资部高级数量分析师，从事指数化投资管理研究工作。博士本科，硕士学位，具有基金从业资格，中国国籍。

注:①任职日期是指本基金合同生效之日;②本基金的含义从行业协会证券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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及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取最大利益。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后公平对待各投资组合，通过完善交易范围内各交易对象的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的绩效评估、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，本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内本基金的投资者交易行为的说明

本基金报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及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取最大利益。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。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金将作为一只投资于沪深300指数的被动投资理财产品，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沪深300指数的投资工具。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末本基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 40,997,746,473.14 99.55

2 固定收益投资 40,997,746,473.14 99.55

3 资产支持证券 - -

4 买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 164,054,629.43 0.40

6 其他资产 20,599,557.64 0.05

合计 41,182,400,660.21 100.00

注:股票投资的公允价值包含可抵扣代扣的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.9 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.10 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.11 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.12 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.13 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.14 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.15 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.16 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.17 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.18 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.19 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.20 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.21 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.22 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.23 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.24 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.25 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.26 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.27 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.28 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.29 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.30 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.31 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.32 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.33 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.34 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.35 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.36 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.37 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.38 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.39 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.40 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.41 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.42 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.43 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.44 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.45 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.46 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.47 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.48 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.49 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.50 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.51 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.52 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.53 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.54 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.55 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.56 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.57 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.58 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.59 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.60 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.61 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.62 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.63 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.64 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.65 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.66 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.67 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.68 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.69 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.70 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.71 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.72 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.73 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.74 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.75 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.76 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.77 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.78 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.79 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.80 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.81 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.82 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.83 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.84 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.85 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.86 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.87 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.88 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.89