

中创400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:中国工商银行股份有限公司

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声明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基金合同规定，于2013年1月15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。投资人应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	259,561,264.00份

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%。

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股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动情况相应调整。

业绩比较基准 中创400指数

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、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(2012年10月1日—2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -4,573,915.71

2.本期利润 -2,051,205.94

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0078

4.期末基金份额净值 234,482,382.17

5.期末基金份额净值 0.9034

注:①本公司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，本期利润为本公司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申购本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2基金净值表现

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

过去三个月 -0.65% 1.51% -0.34% 1.52% -0.31% -0.01%

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400交易型开放式指数证券投资基金历史走势图

图:嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金历史走势图(2012年3月22日至2012年12月31日)

注:本基金基金合同生效日2012年3月22日至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金在基金合同生效日起3个月内为建仓期，建仓完成后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)投资品种限制”的有关约定。

54 管理人报告

4.1基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

杨宇 基金经理、嘉实沪深300ETF联接、嘉实沪深300ETF基金经理、公司结构产品投资部总监 2012年3月22日 - 14年 曾先后担任平安保险投资管理有限公司基金经理，易方达基金管理有限公司投资部总经理，万国(天津)180指数基金经理。2004年7月加入嘉实基金管理有限公司，具有基金从业资格，中国国籍。

注:①任职日期是指本基金基金合同生效之日;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，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、《申银400交易型开放式指数证券投资基金合同》和其他法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则，通过基金管理人资产，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。本基金运营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《证券投资基金行业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平等的机会；通过完善交易内部分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，本基金未发生异常交易行为。

4.4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

本报告期内，本基金日均跟踪误差为0.01%，年度拟合偏离度为0.16%，符合基金合同约定的均跟踪误差不超过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0.9034元，本报告期内基金份额净值增长率为-0.65%，业绩比较基金额净值为-0.34%。

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指数的被动型理财产品，我们将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金净值回撤等带来的对指数投资效果带来的冲击，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。

55 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

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 -11,305,967.49

2.本期利润 92,322,243.55

3.加权平均基金份额本期利润 0.0462

4.期末基金份额净值 2,002,454,643.99

5.期末基金份额净值 1.0012

注:①本公司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申购本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

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

过去三个月 4.83% 2.07% -0.01%

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率历史走势图(对比图)

图:嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金历史走势图(2012年3月22日至2012年12月31日)

注:本基金的基金合同生效日2012年3月22日至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金在基金合同生效日起3个月内为建仓期，建仓完成后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)投资品种限制”的有关约定。

56 投资组合报告

5.1报告期内基金资产组合情况

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 -11,305,967.49

2.本期利润 92,322,243.55

3.加权平均基金份额本期利润 0.0462

4.期末基金份额净值 2,002,454,643.99

5.期末基金份额净值 1.0012

注:①本公司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申购本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

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

过去三个月 4.83% 2.07% -0.01%

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率历史走势图(对比图)

图:嘉实泰和封闭式基金历史走势图(2009年4月8日至2012年12月31日)

注:本基金基金合同生效日2009年4月8日至报告期末未满3年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金在基金合同生效日起3年内为封闭期，封闭期内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)投资品种限制”的有关约定。

57 管理人报告

4.1基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

任竞辉 基金经理、嘉实沪深300ETF基金经理、公司研究部总监 2010年10月 12年 曾任申万巴黎基金管理有限公司行业研究员，中国国际金融有限公司行业研究员，2008年2月加盟嘉实基金管理有限公司任高级分析师，现为公司研究部总监。具有基金从业资格，中国国籍。

注:①任职日期是指本基金基金合同生效之日;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，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、《申银400交易型开放式指数证券投资基金合同》和其他法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则，通过基金管理人资产，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。本基金运营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《证券投资基金行业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平等的机会；通过完善交易内部分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，本基金未发生异常交易行为。

4.4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

本报告期内，本基金日均跟踪误差为0.01%，年度拟合偏离度为0.16%，符合基金合同约定的均跟踪误差不超过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1.0012元，本报告期内基金份额净值增长率为-0.43%，年度拟合偏离度为-0.2%。

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指数的被动型理财产品，我们将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金净值回撤等带来的对指数投资效果带来的冲击，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。

58 投资组合报告

5.1报告期内基金资产组合情况

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 -11,305,967.49

2.本期利润 92,322,243.55

3.加权平均基金份额本期利润 0.0462

4.期末基金份额净值 2,002,454,643.99

5.期末基金份额净值 1.0012

注:①本公司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申购本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

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

过去三个月 4.83% 2.07%

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率历史走势图(对比图)

图:嘉实泰和封闭式基金历史走势图(2009年4月8日至2012年12月31日)

注:报告期内，本基金的基本面投资比例不低于本基金资产净值的90%，投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%；本基金持有一定上市公司的股票，不超过本基金资产净值10%；本基金由与本基金管理人管理的其他基金

59 投资组合报告

5.1报告期内基金资产组合情况

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)