

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
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

1.本期已实现收益

2.本期利润

3.加权平均基金份额本期利润

4.期末基金资产净值

5.期末基金份额净值

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 业绩比较基准收益率② 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

注:本基金基金合同生效日2012年3月22日至报告期末未满一年。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“第三部分二、投资范围和投资限制(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

杨宇 本基金 嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实沪深300ETF基金、公司结构产品投资部总监

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遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《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

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流程和流程独立决策,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,本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金日均跟踪误差为0.01%,年化跟踪偏离度为0.16%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.2%的限。

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%,业绩比较基准收益率为-0.34%。

4.5 管理人对于宏观经济、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跟踪误差带来的冲击,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 231,397,563.41 98.39

其中:股票 231,397,563.41 98.39

2 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

资产支持证券 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中:买断式回购的买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 1,006,895.82 0.43

6 其他资产 2,773,649.18 1.18

合计 235,178,108.41 100.00

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

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 4,762,116.30 2.03

B 采掘业 2,315,532.00 0.99

C 制造业 155,722,439.84 66.41

C0 食品、饮料 7,585,813.74 3.24

C1 纺织、服装、皮毛 6,181,155.35 2.64

C2 木材、家具 1,871,359.56 0.80

C3 造纸、印刷 3,230,246.05 1.38

C4 石油、化学、塑胶、塑料 25,167,426.37 10.73

C5 电子 24,458,969.62 10.43

C6 金属、非金属 18,615,763.08 7.94

C7 机械、设备、仪表 45,774,481.99 19.52

C8 医药、生物制品 18,338,514.39 7.82

C99 其他制造业 4,498,709.69 1.92

D 电力、煤气及水的生产和供应业 1,592,897.56 0.68

E 建筑业 9,666,746.48 4.12

F 交通运输、仓储业 1,487,630.20 0.63

G 信息技术业 26,137,996.53 11.15

H 批发和零售贸易 10,697,838.51 4.56

I 金融、保险业 - -

J 房地产业 2,876,483.77 1.23

K 社会服务业 10,815,749.72 4.61

L 传播与文化业 5,030,273.06 2.15

M 综合类 291,859.44 0.12

合计 231,397,563.41 98.68

5.2.2 报告期末按股票投资按行业分类的股票投资组合

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 300058 蓝色光标 79,930 1,838,390.00 0.78

2 002477 雏鹰农牧 97,050 1,814,835.00 0.77

3 002294 信立泰 46,778 1,791,597.40 0.76

4 002344 海宁皮城 67,082 1,783,039.56 0.76

5 002456 欧菲光 35,200 1,477,344.00 0.63

6 002482 广田股份 69,102 1,426,956.30 0.61

7 300039 上海凯宝 61,007 1,420,242.96 0.61

8 002311 海大集团 81,786 1,398,540.60 0.60

9 002429 兆驰股份 101,395 1,309,009.45 0.56

10 002273 水晶光电 61,556 1,276,055.88 0.54

5.3.2 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股票投资明细

报告期末,本基金未持有股票投资。

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五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.7 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 333,333.34

2 应收证券清算款 2,692,486.01

3 应收股利 -

4 应收利息 -

5 应收申购款 45,804.52

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

合计 3,073,776.33

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 333,333.34

2 应收证券清算款 2,692,486.01

3 应收股利 -

4 应收利息 -

5 应收申购款 45,804.52

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

合计 3,073,776.33

5.9.4 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。

5.9.5 报告期末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 002506 超日太阳 2,812.60 0.01 重大事项停牌

2 300006 莱美药业 20,075.00 0.01 重大事项停牌

3 300183 东软载波 15,256.00 0.01 重大事项停牌

4 002190 成飞集成 14,656.00 0.01 重大事项停牌

5 002460 赣锋锂业 13,517.00 0.01 重大事项停牌

6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期初基金份额总额 228,363,507.85

本报告期基金总申购份额 8,389,085.07

减:本报告期基金总赎回份额 16,186,507.88

本报告期基金净申购份额 16,186,507.88

本报告期末基金份额总额 220,566,085.04

注:报告期内基金总申购份额转换为赎回份额,总赎回份额转换为赎回份额。

§7 备查文件目录

1) 中国证监会批准和证券投资基金设立的文件;

2) 泰和证券投资基金合同;

3) 泰和证券投资基金招募说明书;

4) 泰和证券投资基金托管协议;

5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;

6) 报告期内泰和证券投资基金公告的各项原稿;

7.2 存放地点

北京市建国门内大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

7.3 查阅方式

书面查询:查询时间为每工作日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。

网站查询:基金管理人网址: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 2013年1月21日

嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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联接
基金代码	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	220,566,085.04份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准,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0.35%,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;将在综合考虑仓位、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申购的方式或二级市场交易的方式进行目标ETF的投资。
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

§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

1.本期已实现收益

2.本期利润

3.加权平均基金份额本期利润

4.期末基金资产净值

5.期末基金份额净值

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 业绩比较基准收益率② 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

注:本基金基金合同生效日2012年3月22日至报告期末未满一年。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

杨宇 本基金 嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实沪深300ETF基金、公司结构产品投资部总监

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遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《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

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流程和流程独立决策,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,本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明</