

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
送出日期:2014年3月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员不虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经本基金独立董事签字确认，并由董事长签发。

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2014年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期内2013年1月1日起至2013年12月31日止。

本年度报告摘要自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

§ 2 基金简介

基金简称	嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)
基金简称	嘉实基本面50指数(LOF)(场内简称:嘉实50)
基金代码	160716
基金运作方式	上市契约型开放式
基金的出生日期	2009年12月30日
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
报告期末基金份额总额	1,152,064,194.61份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年2月10日

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)
基金简称	嘉实基本面50指数(LOF)(场内简称:嘉实50)
基金代码	160716
基金运作方式	上市契约型开放式
基金的出生日期	2009年12月30日
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
报告期末基金份额总额	1,152,064,194.61份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年2月10日

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资策略，通过严格的证券投资纪律和数量化的风险管理，追求标的指数的有效跟踪。
投资策略	采取完全复制指数法，按照标的指数的成份股组成及其权重重构股票投资组合，根据标的指数成份股及其权重的变动进行定期调整。
业绩比较基准	中证锐联基本面50指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%
风险收益特征	本基金属于采用被动化操作的股票型基金，其预期的风险和收益水平高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的中高风险、较高收益品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	胡学军	赵立军
信息披露负责人	胡学军	赵立军
联系电话	(010)65215588	(010)66105799
电子邮箱	service@jrjfund.cn	custod@icbc.com.cn
客户服务电话	400-800-8800	95588
传真	(010)65182266	(010)66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址	http://www.jrfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市建国门北大街8号华润大厦嘉实基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	-230,329,763.27	-239,904,774.31	-205,012,773.62
本期利润	-191,270,378.28	212,090,494.20	-363,295,780.10
加权平均基金份额本期利润	-0.0823	0.0771	-0.1255
本期平均净值增长率	-12.33%	12.02%	-16.46%
本期基金份额净值增长率	-10.82%	11.28%	-14.56%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配利润	-573,007,795.28	-786,640,290.01	-1,227,282,172.04
期末可供分配基金份额比例	-0.0736%	-0.2975%	-0.3687%
期末基金净值	957,369,606.26	1,857,801,785.68	2,100,969,877.74
期末基金份额净值	0.6263	0.7028	0.6013
3.1.3 年末期末数据	2013年末	2012年末	2011年末
基金总资产净值增长率	-37.35%	-29.75%	-36.87%

注: (1)本期未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,本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益; (2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时所发生的基金交易费用;

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率为及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长 率(单位:%)	业绩比较基 准收益率(单 位:%)	份额净值 增长标准差 (单位:%)	①-③	②-④
过去三个月	-3.63%	1.06%	-3.50%	1.06%	-0.13%
过去六个月	4.45%	3.41%	1.24%	1.04%	0.02%
过去一年	-10.82%	1.39%	-12.34%	1.38%	1.52%
过去三年	-15.21%	1.18%	-17.84%	1.18%	2.63%
自基金合同生 效起至今	-37.35%	1.24%	-38.62%	1.26%	1.27%

注:本基金业绩比较基准为:中证锐联基本面50指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%。

中证锐联基本面50指数以基本面指标衡量上市公司的经济规模,选取其中最大的50家A股上市公司作为样本,且样本个数的权重配置与其经济规模相适应。该指数综合反映了中国证券市场基本面良好企业的整体状况,适合作为基金的业绩基准。

本基金的业绩基准按照指数化投资策略每交易日进行计算,计算方式如下:

Benchmark=(1+Return (t)) × Benchmark (t-1)

Return(t)=95%×(中证锐联基本面50指数(t)/中证锐联基本面50指数(t-1))-5%×银行同业存款每日收益率

3.2.2 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

图:嘉实基本面50指数(LOF)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

(2000年12月31日至2013年12月31日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,基金合同自基金合同生效之日起1年内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十一)一、投资限制(十七)二、投资组合比例限制)的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 过去三年基金的利得和配息情况

过去三年本基金未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一,是外商合资基金管理公司,公司注册资本在北京设立的成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获准首批全国社保基金、企业年金投资管理人和RQDII,特定资产管理业务资质。

截至2013年12月31日,基金管理人拥有员工300余人,其中具有硕士以上学位的员工占全体员工的60%以上,具有本科以上学历的员工占全体员工的90%以上。

4.1.2 基金经理的管理基金经验

本基金基金经理为胡学军先生,现任公司总经理,具备15年以上的证券从业经验,并具有丰富的行业研究经验。

本基金基金经理胡学军先生,毕业于中国科技大学,获得硕士学位,并取得CFA、FRM、CPA、CIMA等国际注册会计师、精算师、金融分析师等资格,具有丰富的证券从业经验。

4.2 基金管理人对报告期内基金运作的总体评价

报告期内,本基金严格按照《证券投资基金法》及其各项配套法规的规定,忠实履行诚实守信、勤勉尽责的基本义务,有效执行了各项规章制度,实现了基金资产的保值增值,较好地完成了投资目标。

4.3 管理人对报告期内基金交易行为的专项说明

公司制定了《公平交易管理制度》,根据证监会《证券投资基金交易行为监管指引第1号——公平交易》等法律法规,从组织架构、岗位设置和制度建设、内部控制和信息披露等方面,确保在投资决策、交易执行、业绩评估等环节公平对待所有投资组合,杜绝不公平交易行为,保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求对同一上市股票、同组组合同时进行买卖,保证各组合公平对待所有投资组合。

公司公平交易管理制度要求对不同投资组合公平对待所有投资组合,保证各组合公平对待所有投资组合。

公司公平交易管理制度要求对不同投资组合公平对待所有投资组合,保证各组合公平对待所有投资组合。