

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
报告期结束日期:2012年4月3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2012年4月17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。
本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资风险,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。
本报告期期初的财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§ 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	510,906,143.00份
投资目标	紧密跟踪业绩基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法,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	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1月1日 - 2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-17,405,224.30
2.本期利润	20,235,241.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0383
4.期末基金资产净值	430,063,204.29
5.期末基金份额净值	0.8418

注:①本期利润为本报告期利息收入、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金额;②本期利润已实现收益加上本期公允价值变动收益;③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要低于所列数字。

3.2 本基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

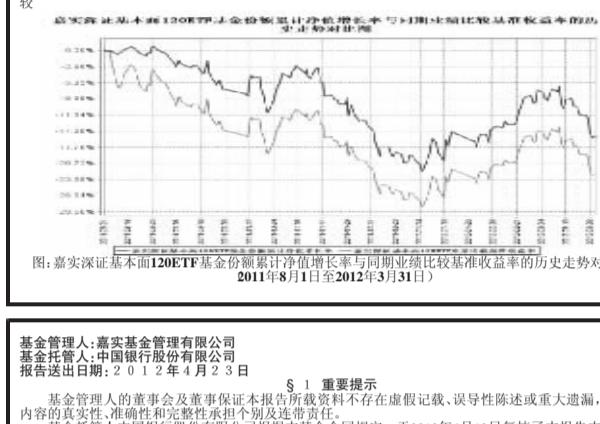


图:嘉实深证基本面120ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2011年8月1日至2012年3月31日)

§ 4 报告期末基金资产组合情况

§ 5 投资组合报告

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额 586,906,143.00

本报告期基金总申购份额 64,000,000.00

本报告期基金赎回份额 140,000,000.00

本报告期末基金份额总额 510,906,143.00

§ 7 备查文件目录

7.1 各文件目录

7.2 基金合同批准文件基本120交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

7.3 批准本基金120交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;

7.4 批准本基金120交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议;

7.5 基金管理人业务资格批件、营业执照;

7.6 基金管理人最近12月内未受过行政处罚的说明;

7.7 存续期文件

北京市建银国际北大街8号华润大厦嘉实基金管理有限公司。

7.8 查阅方式

7.9 复印件

7.10 网站查询:查阅时间为每周工作日:30-11;30,13-00;17-30。投资者可免费查阅,也可按工本费购买

7.11 投资者对本报告如有疑问,可咨询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 2012年4月23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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月17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。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资风险,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。

本报告期期初的财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

本报告期(2012年1月1日 - 2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -97,869,959.43

2.本期利润 13,325,884.34

3.加权平均基金份额本期利润 0.0355

4.期末基金资产净值 327,219,140.65

5.期末基金份额净值 0.8770

注:①本期已实现收益指本基金利息收入、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金额,本期利润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 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

§ 4 报告期末债券品种分类的债券投资组合

§ 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十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 120211 12国开11 2,000,000.00 200,040,000.00 11.15

2 1001037 10央行票据37 700,000.00 69,552,000.00 3.88

3 1100122 11央行票据22 500,000.00 48,405,000.00 2.70

4 010203 02国债(3) 362,750.00 36,278,627.50 2.02

5 1101088 11央行票据88 300,000.00 29,019,000.00 1.62

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额 384,059,732.00

本报告期基金总申购份额 12,922,523.23

本报告期基金总赎回份额 23,865,893.70

本报告期末基金份额总额 373,116,371.73

§ 7 备查文件目录

7.1 各文件目录

7.2 基金合同批准文件基本120交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

7.3 批准本基金120交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;

7.4 批准本基金120交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议;

7.5 基金管理人业务资格批件、营业执照;

7.6 其他法律法规

7.7 存续期文件

北京市建银国际北大街8号华润大厦嘉实基金管理有限公司。

7.8 查阅方式

7.9 复印件

7.10 网站查询:查阅时间为每周工作日:30-11;30,13-00;17-30。投资者可免费查阅,也可按工本费购买

7.11 投资者对本报告如有疑问,可咨询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 2012年4月23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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月17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。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资风险,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。

本报告期期初的财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

本报告期(2012年1月1日 - 2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -56,899,486.68

2.本期利润 46,372,007.81

3.加权平均基金份额本期利润 0.0232

4.期末基金资产净值 1,793,596,537.72

5.期末基金份额净值 0.8968

注:①本期已实现收益指本基金利息收入、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金额,本期利润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 本基金合同生效以来基金份额累计净值增长率历史走势对比图

图:嘉实泰和证券投资基金基金份额累计净值增长率历史走势对比图(2009年1月1日至2012年3月31日)

§ 4 管理人报告

§ 5 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 1,142,968,013.98 63.23

2 固定收益投资 444,424,150.70 24.58

3 资产支持证券 444,424,150.70 24.58

4 买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 212,337,368.17 11.75

6 其他资产 8,043,705.39 0.44

合计 1,807,773,103.24 100.00

§ 6 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 采矿业 - -

C 制造业 246,689,488.29 13.53

D 食品、饮料、纺织、皮革 36,461,235.10 2.04

E 纺织、服装、皮毛 3,260,467.30 0.18

F 木材、家具 20,530,163.20 1.14

G 造纸、印刷、出版 5,286,183.00 0.30

H 石油、化学、塑胶、塑料 16,020,256.00 0.90

I 电子 11,876,722.40 0.64