

深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金

2014第三季度报告

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:2014年10月24日

\$ 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2014年10月21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2014年7月1日起至2014年9月30日止。

\$ 1 基金产品概况

基金简称	嘉实深证基本面120ETF
场内简称	深证120
基金代码	159910
基金运作方式	交易型开放式
报告期末基金份额总额	237,906,143.00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。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的构成比例及其权重构建股票投资组合，并定期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，长期预期风险和预期收益水平高于股票型基金，预期收益水平低于债券型基金。本基金为指数基金，被动跟踪和指数的表现，具有与标的指数相似的指数特征，即标的指数所代表的股票市场平均的风险收益特征。
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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	-561,672.30
2.本期利润	34,117,683.09
3.报告期平均基金份额本期利润	0.1330
4.期末基金资产净值	203,539,462.81
5.期末基金份额净值	0.8555

(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类费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数字。)

3.2 基金主要财务指标

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	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.93%	0.96%	17.48%	0.97%	0.45%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

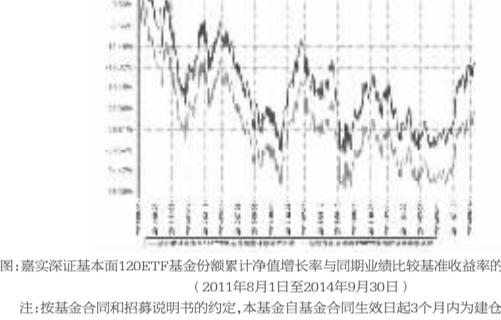


图:嘉实深证基本面120ETF基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2014年7月1日至2014年9月30日)

注:按基金合同和招募说明的规定,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“十五、基金的投资(二)投资范围和(八)、基金投资组合比例限制”的有关规定。

\$ 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间	证券从业年限	说明
杨宇	本基金 嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接基金、嘉实沪深300指数增强型基金、嘉实沪深300指数基金、嘉实沪深300指数增强型LOF、嘉实H股指数基金、嘉实中证500指数基金、嘉实中证500指数增强型基金、嘉实中证500指数增强型LOF、嘉实量化对冲策略基金(QDII-FOF-LOF)基金经理,公司固定收益部总监	2014年3月11日	-	16年 曾任先后担任平安保险投资管理中心基金经理及固定收益部总监,2004年7月加入嘉实基金管理有限公司,历任基金经理、研究员、行业研究员、基金经理助理、研究组组长、基金经理等职务,现任嘉实基金管理有限公司固定收益部总监。

注:(1)任职日期、离任日期是经公司作出决定后公告之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《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遵守“守信情况”的说明

报告期内,本基金经理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《深证基本面120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适用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

报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超量且该证券当日成交量较低的,合计20X,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金的报备情况说明

4.4.1 报告期内基金投资运作分析

报告期内,本基金日均跟踪误差为0.03%,年度化拟合偏度为0.54%。符合基金合同约定的拟合度不超过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0.8555元;本基金报告期基金份额净值增长率为17.93%,业绩比较基

准收益率为17.48%;本期费用合计为0.1330元;期末基金资产净值为203,539,462.81元;期末基金份额净值为0.8555元,与同期业绩比较基准收益率的差值为0.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

作为被动管理的指数基金,本基金在严控基金合同及相关法律法规要求的前提下,将继续秉承指数化投资策略,积极把握对基金投资回报等要素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差,力争投资回报与业绩基准保持一致。

4.6 投资组合报告

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

4.7 基金产品概况

基金名称	嘉实沪深300ETF
基金代码	000955
基金运作方式	交易型开放式
报告期末基金份额总额	2,763,780,836.98份
投资目标	分享中国经济改革与发展成果,密切关注沪深A股上市公司经营情况,主动把握企业成长的投资机会,谋取基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深300指数*97.0%+国债指数*3.0%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益及风险水平高于股票型基金,但低于混合型基金,并高于债券型基金、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	中国建设银行股份有限公司

4.8 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类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

4.9 基金的费用情况

4.9.1 本报告期费用情况

4.9.2 本报告期费用情况

4.9.3 本报告期费用情况

4.9.4 本报告期费用情况

4.9.5 本报告期费用情况

4.9.6 本报告期费用情况

4.9.7 本报告期费用情况

4.9.8 本报告期费用情况

4.9.9 本报告期费用情况

4.9.10 本报告期费用情况

4.9.11 本报告期费用情况

4.9.12 本报告期费用情况

4.9.13 本报告期费用情况

4.9.14 本报告期费用情况

4.9.15 本报告期费用情况

4.9.16 本报告期费用情况

4.9.17 本报告期费用情况

4.9.18 本报告期费用情况

4.9.19 本报告期费用情况

4.9.20 本报告期费用情况

4.9.21 本报告期费用情况

4.9.22 本报告期费用情况

4.9.23 本报告期费用情况

4.9.24 本报告期费用情况

4.9.25 本报告期费用情况

4.9.26 本报告期费用情况

4.9.27 本报告期费用情况

4.9.28 本报告期费用情况

4.9.29 本报告期费用情况

4.9.30 本报告期费用情况

4.9.31 本报告期费用情况

4.9.32 本报告期费用情况

4.9.33 本报告期费用情况

4.9.34 本报告期费用情况

4.9.35 本报告期费用情况

4.9.36 本报告期费用情况

4.9.37 本报告期费用情况

4.9.38 本报告期费用情况

4.9.39 本报告期费用情况

4.9.40 本报告期费用情况

4.9.41 本报告期费用情况

4.9.42 本报告期费用情况

4.9.43 本报告期费用情况

4.9.44 本报告期费用情况

4.9.45 本报告期费用情况

4.9.46 本报告期费用情况

4.9.47 本报告期费用情况

4.9.48 本报告期费用情况

4.9.49 本报告期费用情况

4.9.50 本报告期费用情况

4.9.51 本报告期费用情况

4.9.52 本报告期费用情况

4.9.53 本报告期费用情况

4.9.54 本报告期费用情况

4.9.55 本报告期费用情况

4.9.56 本报告期费用情况

4.9.57 本报告期费用情况

4.9.58 本报告期费用情况

4.9.59 本报告期费用情况