

# 信息披露 disclosure

## 嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金

### 2014 年 度 报 告 摘 要

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  
送出日期:2015年3月31日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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法律责任。本年度报告已经基金董事会审议通过,并由董事长签署。

基金托管人中国银行股份有限公司,对嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金2014年度财务报告进行了复核,并出具了复核报告。基金托管人认为,基金管理人提供的财务数据真实、准确,符合会计准则,且与基金管理人提供的财务数据一致。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者投资于本基金,须自行承担投资风险。投资者在作出投资决策前,应仔细阅读基金招募说明书及基金合同。

本报告自2014年1月1日起至2014年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

基金名称	嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实沪深300ETF
场内简称	300ETF
基金代码	159919
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日期	2012年5月21日
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
报告期末基金份额总额	12,457,966,477.00份
基金合同存续期限	不定期
基金申购赎回场所	深圳证券交易所
上市日期	2012年5月28日

基金产品说明	基金运作方式
基金目标	本基金通过被动式指数化投资,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	本基金采用完全复制法,即完全按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合进行被动投资,并根据标的指数成份股及其权重进行相应调整。但在因特殊原因或因流动性不足等原因导致无法获得足够数量的成份股时,基金管理人可根据市场情况,对投资组合中的个别成份股进行替代,以期更接近标的指数的表现。
业绩比较基准	沪深300指数
风险收益特征	本基金为被动基金,其长期平均风险和预期收益率与沪深300指数相类似。本基金为指数基金,跟踪标的指数的表现,具有与标的指数及标的指数所代表的股票市场的相似的风险收益特征。

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	王长林
联系电话	(010)65121588
电子邮箱	service@jia.com.cn
客户服务电话	400-600-8800
	(010)65182266
	(010)65949422

本基金经理人投资估值委员会成员,委员包括固定收益、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成,负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内,固定收益组负责人同时兼任基金经理,估值委员,基金经理参加估值专业委员会会议,但不参与基金估值业务,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。与估值相关的系统包括上海、深圳证券交易所,中国证券登记结算有限责任公司、中国登记结算有限公司以及中国证监会业协会。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内,基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对于本基金持有人或基金资产净值损害情况的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,对本基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整。

5.4 托管人对本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整。

5.5 托管人对本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整。

5.6 托管人对本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整。

5.7 托管人对本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整。

本基金经理人投资估值委员会成员,委员包括固定收益、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成,负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内,固定收益组负责人同时兼任基金经理,估值委员,基金经理参加估值专业委员会会议,但不参与基金估值业务,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。与估值相关的系统包括上海、深圳证券交易所,中国证券登记结算有限责任公司、中国登记结算有限公司以及中国证监会业协会。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内,基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对于本基金持有人或基金资产净值损害情况的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,对本基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整。

5.4 托管人对本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整。

5.5 托管人对本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整。

5.6 托管人对本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整。

5.7 托管人对本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,本年度报告中财务信息内容真实、准确和完整。

</