

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、监事会对本基金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的法律责任。本基金报告已经全部独立董事签字同意，并由董事审核签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2015年3月26日复核了本基金报告的法律指标、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。

本报告期自2014年1月1日起至2014年12月31日。

本年度报告摘要年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

2 基金简介

基金名称	嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	嘉实深证基本面120ETF联接
基金代码	070023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月1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
基金类别	股票型基金
报告期基金资产总值	190,187,735,705
报告期净值	未知

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	嘉实深证基本面120ETF联接
基金代码	070023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月1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
报告期基金资产总值	190,187,735,705
报告期净值	未知

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为交易型开放式基金，通过投资于ETF实现对标的指数的紧密跟踪。在投资过程中，本基金在充分考虑流动性、风险、成本、本币利率、汇率、税率等影响因素的基础上，决定采用一级市场申购和一级市场交易的方式。
业绩比较基准	深证基本面120指数*95%+银行存款利率*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金，风险和收益水平高于货币市场基金，风险和收益水平低于股票型基金。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	本基金为交易型开放式指数基金，紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为交易型开放式基金，通过投资于ETF实现对标的指数的紧密跟踪。在投资过程中，本基金在充分考虑流动性、风险、成本、本币利率、汇率、税率等影响因素的基础上，决定采用一级市场申购和一级市场交易的方式。
业绩比较基准	深证基本面120指数*95%+银行存款利率*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金，风险和收益水平高于货币市场基金，风险和收益水平低于股票型基金。

2.2.2 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	中国银行股份有限公司
办公地址	湖南省	上海市
信息披露负责人	胡静怡	王永强
联系电话	(010)65215588	(010)66994986
电子邮箱	service@jrufund.com	fdcb@cboc.com.cn
客户服务电话	400-761-0800	95566
报告期基金资产总额	(010)65182266	(010)66994942

2.4 信息披露方式

基金基本情况公告的发布刊物名称	http://www.jrfund.cn
基金年度报告发布地点	北京市建银国际大厦B座16层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

金额单位:人民币元

1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	-1,805,524.26	-37,390,806.23	-7,180,835.56
本期利润	75,361,712.40	-20,003,025.86	425,209.11
加权平均基金份额利润	0.3240	-0.0614	0.0009
期末基金份额净值	41.32%	-7.35%	0.11%
本期份额净值增长	49.72%	-5.36%	0.98%
1.2 期末数据	2014年12月31日	2013年12月31日	2012年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.1746	-0.1945	-0.1489
期末可供分配利润	229,370,075.00	206,789,762.18	407,141,147.95
期末可供分配利润	1,2060	0.9655	0.8111
期末可供分配利润扣减基准收益	2014年12月31日	2013年12月31日	2012年12月31日
期末可供分配利润扣减基准收益	20.60%	-19.45%	-14.99%

注:1)本期已实现收益指基金本期收入,收入包括利息收入、股息收入、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关税费后的余额,本期利润为已实现收入加上本期公允价值变动收益(不含)所导致的基金净值损失不包括个人认购交易基金的管理费用,各项费用用人民币元表示,公允价值用人民币元表示,所列数字以千位为单位,除特别说明外,基金净值损失率=基金净值损失/基金净值。

2)本期可供分配利润指基金本期利润减去基金本期利润按照10%的税率缴纳的所得税后的金额。

3)本基金未可分配利润指期末可供分配利润中扣除已计提的现金分红部分。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

1.1 期间数据和指标	份额净值增长	业绩比较基准	份额净值增长	业绩比较基准	①-③	②-④
过去二个月	35.64%	1.5%	36.55%	1.55%	-0.91%	-0.02%
过去六个月	58.68%	1.25%	59.17%	1.27%	-0.49%	-0.02%
过去一年	49.72%	1.19%	49.25%	1.20%	0.47%	-0.01%
过去两年	43.09%	1.26%	43.67%	1.30%	1.42%	-0.02%
过去三年	20.69%	1.25%	37.35%	1.31%	14.65%	-0.00%

注:本基金业绩比较基准为:深证基本面120指数*65%+银行同业存款利率*5%。

深证基本面120指数选取深圳证券交易所上市的120家基本面指标(营业收入、净利润、资产总额、负债总额)综合评价较高的公司作为样本,样本的权重配比与其经济规模相适应。具有良好的基本面、市场代表性和流动性,并在一定程度上减少了高估股票在组合中权重过高的现象。

本基金的业绩基准指按照构建公式每交易日进行计算,计算方式如下:

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%*(深证基本面120指数(t-1)/深证基本面120指数(t-1)-1)+5%*银行同业存款利率

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

其中t=1,2,3,...

3.2.2 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的比较

1.1 期间数据和指标	份额净值增长	业绩比较基准	份额净值增长	业绩比较基准	①-③	②-④
过去二个月	35.64%	1.5%	36.55%	1.55%	-0.91%	-0.02%
过去六个月	58.68%	1.25%	59.17%	1.27%	-0.49%	-0.02%
过去一年	49.72%	1.19%	49.25%	1.20%	0.47%	-0.01%
过去两年	43.09%	1.26%	43.67%	1.30%	1.42%	-0.02%
过去三年	20.69%	1.25%	37.35%	1.31%	14.65%	-0.00%

注:本基金合同生效日为2011年8月1日,2011年度的相关数据根据当年实际存续期(2011年8月1日至2011年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

3.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及基金经理的经营

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,是中外合资基金管理公司。公司注册资本在北京设有总部,在上海、总部,深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、公司,公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定客户资产管理业务资格。

截至2014年12月31日,基金管理人共管理一只开放式证券投资基金,66只开放式证券投资基金,具体包括股票型和混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII基金、基金中基金(FOF)、基金中基金(LOF)、基金中基金(FOF-LOF)、基金中基金(QDII-LOF)、基金中基金(QDII-FOF)、基金中基金(QDII-FOF-LOF)、基金中基金(QDII-FOF-LOF-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-FOF)、基金中基金(QDII-QDII-FOF-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-FOF-LOF-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-FOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-FOF-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-FOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-FOF-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-FOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-FOF-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-FOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-FOF-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-FOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-FOF-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-FOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-FOF-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-QDII-LOF)、基金中基金(QDII-QDII-QDII