

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:2012年3月30日
重要提示
嘉实深证基本面120联接基金...

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
基金代码:070023
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2011年8月1日

2.2 基金业绩说明
截至报告期末,本基金跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略:本基金为纯被动ETF联接基金,主要投资于目标ETF,实现对业绩比较基准的紧密跟踪。
投资目标:本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标
3.1.3 主要财务指标

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对比
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

嘉实深证基本面120联接基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的历史走势图对比图
注:本基金管理人于2011年8月1日披露跟踪标的指数的历史走势图对比图,本基金自合同生效起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“四、基金的投资”中关于基金资产配置比例的相关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金业绩净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比
嘉实深证基本面120联接基金合同生效以来基金业绩净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的对比图
注:本基金管理人于2011年8月1日披露跟踪标的指数的历史走势图对比图,本基金自合同生效起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“四、基金的投资”中关于基金资产配置比例的相关规定。

3.2.4 自基金合同生效以来基金业绩净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比
嘉实深证基本面120联接基金合同生效以来基金业绩净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的对比图
注:本基金管理人于2011年8月1日披露跟踪标的指数的历史走势图对比图,本基金自合同生效起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“四、基金的投资”中关于基金资产配置比例的相关规定。

3.2.5 自基金合同生效以来基金业绩净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比
嘉实深证基本面120联接基金合同生效以来基金业绩净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的对比图
注:本基金管理人于2011年8月1日披露跟踪标的指数的历史走势图对比图,本基金自合同生效起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“四、基金的投资”中关于基金资产配置比例的相关规定。

3.2.6 自基金合同生效以来基金业绩净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比
嘉实深证基本面120联接基金合同生效以来基金业绩净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的对比图
注:本基金管理人于2011年8月1日披露跟踪标的指数的历史走势图对比图,本基金自合同生效起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“四、基金的投资”中关于基金资产配置比例的相关规定。

3.2.7 自基金合同生效以来基金业绩净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比
嘉实深证基本面120联接基金合同生效以来基金业绩净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的对比图
注:本基金管理人于2011年8月1日披露跟踪标的指数的历史走势图对比图,本基金自合同生效起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“四、基金的投资”中关于基金资产配置比例的相关规定。

3.2.8 自基金合同生效以来基金业绩净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比
嘉实深证基本面120联接基金合同生效以来基金业绩净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的对比图
注:本基金管理人于2011年8月1日披露跟踪标的指数的历史走势图对比图,本基金自合同生效起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“四、基金的投资”中关于基金资产配置比例的相关规定。

3.2.9 自基金合同生效以来基金业绩净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比
嘉实深证基本面120联接基金合同生效以来基金业绩净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的对比图
注:本基金管理人于2011年8月1日披露跟踪标的指数的历史走势图对比图,本基金自合同生效起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“四、基金的投资”中关于基金资产配置比例的相关规定。

3.2.10 自基金合同生效以来基金业绩净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比
嘉实深证基本面120联接基金合同生效以来基金业绩净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的对比图
注:本基金管理人于2011年8月1日披露跟踪标的指数的历史走势图对比图,本基金自合同生效起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“四、基金的投资”中关于基金资产配置比例的相关规定。

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

2011年度报告摘要

2011年12月31日

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
4.8 报告期内基金业绩比较基准的说明
4.9 报告期内基金净值增长情况的说明

5.1 报告期内基金管理人遵守情况的情况说明
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
5.3 报告期内基金管理人遵守法律法规及其他有关规定、履行信息披露义务的说明

5.4 报告期内基金管理人遵守法律法规及其他有关规定、履行信息披露义务的说明
5.5 报告期内基金管理人遵守法律法规及其他有关规定、履行信息披露义务的说明

资产负债表
单位:人民币元
资产 负债和所有者权益
货币资金 8,034,959.54
交易性金融资产 315,732,162.38
其中:股票投资 12,403,350.00

4.4.1 基金业绩比较基准
4.4.2 基金业绩比较基准的说明
4.4.3 基金业绩比较基准的说明

关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(中国银行) 基金托管人、基金代销机构

4.4.4 关联方交易
4.4.5 关联方交易
4.4.6 关联方交易
4.4.7 关联方交易

资产负债表
单位:人民币元
资产 负债和所有者权益
货币资金 8,034,959.54
交易性金融资产 315,732,162.38

4.4.8 关联方交易
4.4.9 关联方交易
4.4.10 关联方交易
4.4.11 关联方交易

资产负债表
单位:人民币元
资产 负债和所有者权益
货币资金 8,034,959.54
交易性金融资产 315,732,162.38

4.4.12 关联方交易
4.4.13 关联方交易
4.4.14 关联方交易
4.4.15 关联方交易

资产负债表
单位:人民币元
资产 负债和所有者权益
货币资金 8,034,959.54
交易性金融资产 315,732,162.38

4.4.16 关联方交易
4.4.17 关联方交易
4.4.18 关联方交易
4.4.19 关联方交易

资产负债表
单位:人民币元
资产 负债和所有者权益
货币资金 8,034,959.54
交易性金融资产 315,732,162.38

4.4.20 关联方交易
4.4.21 关联方交易
4.4.22 关联方交易
4.4.23 关联方交易

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 债券品种 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 国债券种 -- --
2 央行票据 9,673,000.00 2.99

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 1101010 11国债附息30 100,000 9,673,000.00 2.99

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 嘉实深证基本面120ETF 股票型 交易型开放式 嘉实基金管理 293,655,812.38 90.72

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 项目 本期 上期
当期发生的基金应支付的托管费 693,891.37
其中:支付给销售机构的客户维护费 330,500.59

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 项目 本期 上期
当期发生的基金应支付的托管费 138,778.26
其中:支付给销售机构的客户维护费 --

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 项目 本期 上期
当期发生的基金应支付的托管费 138,778.26
其中:支付给销售机构的客户维护费 --

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 项目 本期 上期
当期发生的基金应支付的托管费 138,778.26
其中:支付给销售机构的客户维护费 --

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 项目 本期 上期
当期发生的基金应支付的托管费 138,778.26
其中:支付给销售机构的客户维护费 --

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 项目 本期 上期
当期发生的基金应支付的托管费 138,778.26
其中:支付给销售机构的客户维护费 --

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 项目 本期 上期
当期发生的基金应支付的托管费 138,778.26
其中:支付给销售机构的客户维护费 --

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 项目 本期 上期
当期发生的基金应支付的托管费 138,778.26
其中:支付给销售机构的客户维护费 --

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 项目 本期 上期
当期发生的基金应支付的托管费 138,778.26
其中:支付给销售机构的客户维护费 --

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 项目 本期 上期
当期发生的基金应支付的托管费 138,778.26
其中:支付给销售机构的客户维护费 --

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 项目 本期 上期
当期发生的基金应支付的托管费 138,778.26
其中:支付给销售机构的客户维护费 --

基金投资组合报告
单位:人民币元
序号 项目 本期 上期
当期发生的基金应支付的托管费 138,778.26
其中:支付给销售机构的客户维护费 --