嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

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
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2012年5月28日
公告日期：2012年5月23日

一、重要声明与提示

《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号（上市交易公告书的内容与格式）》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2012年3月27日《中国证券报》上的《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书同时发布在本公司网站（www.jsfund.cn）。

二、基金概览

1. 基金名称：嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金
2. 基金类型：股票型
3. 基金运作方式：交易型开放式
4. 基金场内简称：300ETF
5. 基金代码：159919
6. 标的指数简称：沪深300指数
7. 标的指数代码：399300
8. 基金份额总额：
截至2012年5月21日，本基金的基金份额总额为19,333,307,392.00份。
9. 基金份额净值：
截至2012年5月21日，本基金的基金份额净值为0.9734元。
10. 本次上市交易的基金份额：19,333,307,392.00份
11. 上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
12. 上市交易日期：2012年5月28日
13. 基金管理人：嘉实基金管理有限公司
14. 基金托管人：中国银行股份有限公司
15. 登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司
16. 申购赎回代理券商：广发证券、招商证券、海通证券、国泰君安证券、国信证券、平安证券、中信证券、中信万通证券、中信证券（浙江）、光大证券、申银万国证券、中国银河证券、安信证券、中信建投证券、兴业证券、东方证券、长江证券、长城证券、湘财证券、中投证券、渤海证券。

三、基金份额的募集与上市交易

（一）上市前基金募集情况

1. 基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2012】393号
2. 基金合同生效日：2012年5月7日
3. 运作方式：交易型开放式
4. 基金合同期限：不定期
5. 发售日期：2012年4月5日至2012年4月27日。其中，网上现金认购的日期为2012年4月5日至2012年4月27日，通过基金管理人进行网下现金认购为2012年4月5日至2012年4月27日，通过发售代理机构进行网下股票认购的日期为2012年4月23日至2012年4月27日。
6. 发售价格：1.00元人民币
7. 份额发售方式：场内、场外认购
8. 发售机构：
1）网下现金发售直销机构：
嘉实基金管理有限公司
2）网上现金发售代理机构：
具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司
3）网下股票发售代理机构：
中信建投证券、招商证券、广发证券、中信证券、中国银河证券、海通证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、中信证券（浙江）、民生证券、国元证券、渤海证券、山西证券、中信万通、东吴证券、信达证券、东方证券、方正证券、长城证券、光大证券、广州证券、东北证券、南京证券、新时代证券、浙商证券、平安证券、国海证券、东莞证券、中原证券、国都证券、东海证券、华西证券、齐鲁证券、第一创业、德邦证券、华福证券、中投证券、江海证券、国金证券、中国民族证券、华宝证券、爱建证券、华融证券、国泰君安证券、华泰证券、湘财证券、宏源证券、国信证券、上海证券、东兴证券、西部证券、世纪证券、恒泰证券、中银国际、中航证券、中金公司。
9. 验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
10. 募集资金总额及入账情况
本次募集的净认购金额为19,332,261,440.00元人民币（含所募集股票市值），认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计1,045,952.00元人民币。本次募集所有资金已于2012年5月7日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管专户。
本次募集有效认购户数为88,675户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计19,333,307,392.00份，已全部计入各基金份额持有人的基金账户。
11. 本基金募集备案情况：本基金于2012年5月7日验资完毕，2012年5月7日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2012年5月7日获得书面确认，本基金合同自该日起正式生效。
12. 基金合同生效日：2012年5月7日
13. 基金合同生效日的基金份额总额：19,333,307,392.00份。

（二）本基金日常申购、赎回情况

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购、赎回。基金管理人在申购开始日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（三）本基金上市交易的主要内容

1. 基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上【2012】131号
2. 上市交易日期：2012年5月28日
3. 上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。
投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4. 基金场内简称：300ETF
5. 基金交易代码：159919
6. 本次上市交易份额：19,333,307,392.00份
7. 未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）基金份额持有情况

截至2012年5月21日，本基金持有人户数为88,675户，平均每户持有的基金份额为218,024.33份。

截至2012年5月21日，机构投资者持有的基金份额为12,217,812,687.00份，占基金总份额的比例为63.20%；个人投资者持有的基金份额为7,115,494,705.00份，占基金总份额的比例为36.80%。

（二）基金份额前十名持有人情况

截至2012年5月21日，前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称	持有份额（份）	占基金总份额比例（%）
1	全国社保基金四零二组合	903,401,132.00	4.67
2	全国社保基金四零七组合	903,398,644.00	4.67
3	中国平安人寿保险股份有限公司—传统—高利率保单产品	799,749,000.00	4.14
4	新华人寿保险股份有限公司	717,649,000.00	3.71
5	广发证券股份有限公司	637,943,838.00	3.30
6	海通证券股份有限公司	600,596,378.00	3.11
7	招商证券股份有限公司	600,579,385.00	3.11
8	国泰君安证券股份有限公司	500,144,274.00	2.59
9	申银万国证券股份有限公司	400,014,999.00	2.07
10	中国银河证券股份有限公司	361,335,409.00	1.87
合计		6,424,812,059.00	33.23

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、公司概况
名称：嘉实基金管理有限公司
法定代表人：安奎
总经理：赵学军
注册资本：1.5亿元人民币
注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期23楼01-03单元
设立批准文号：中国证监会证监基字【1999】5号
工商登记注册的法人营业执照文号：100000400011239
经营范围：基金募集；基金销售；资产管理及中国证监会许可的其他业务
成立日期：1999年3月25日
2、股东及其出资比例：中诚信托有限责任公司40%，德意志资产管理（亚洲）有限公司30%，立信投资有限责任公司30%。
3、内部组织结构及职能
公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。
公司目前下设股票投资部、固定收益部、结构产品投资部、定量投资部、机构投资部、研究部、交易部、风险管理部、监察稽核部、法律部、产品管理部、机构业务体系、渠道发展部、营销策划部、客户服务部、电子商务部、基金运营部、登记结算部、信息技术部、财务部、人力资源部、行政管理部、战略发展部等部门。
股票投资部、固定收益部、定量投资部、结构产品投资部和机构投资部负责根据投资决策委员会制定的原则进行投资。研究部负责行业、上市公司研究和投资策略研究。交易部负责完成基金经理交易指令。风险管理部负责公司投资风险分析与管理、投资流程、绩效考核。监察稽核部和法律部负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查。产品管理部负责新产品开发以及相关的市场营销研究、法律环境研究和理财策略研究等。机构业务体系主要负责年金、专户、机构客户及高端个人基金销售的开发与维护。渠道发展部、营销策划部、电子商务部、客户服务部负责市场推广、基金销售、客户服务、销售渠道管理等业务。信息技术部、基金运营部、登记结算部负责公司信息系统的日常运行与维护跟踪研究新技术，进行相应的技术系统规划与开发、基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务。财务部负责公司财务管理工作。人力资源部和行政管理部负责公司企业文化建设、文字档案、相关后勤服务、人力资源管理、薪酬制度、人员培训、人事档案等事务等综合事务管理。战略发展部负责公司经营战略规划、新业务发展等。
4、人员情况
截至2012年3月31日，我公司共有459名员工，其中博士学位24人、硕士学位230人、学士学位189人、其他16人。
5、信息披露负责人：胡勇钦
咨询电话：010-65215588
6、基金管理业务情况
截止2012年3月31日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、31只开放式证券投资基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数（QDII－LOF）、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400联接。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。
7、本基金基金经理简介
杨宇先生，经济学硕士，毕业于南开大学数学系和金融学系，具有 13 年证券从业经验。曾任平安证券有限责任公司资产管理部证券分析师、中国平安保险股份有限公司投资管理中心基金交易室主任、天同基金管理公司投资管理部部门经理，2003 年 3 月 15 日至 2004 年 7月 7 日任万家（原天同）180 指数证券投资基金基金经理。2004 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，2005 年 8 月 29 日至今任嘉实沪深300 指数基金基金经理，2012年3月22日至今任嘉实中创400ETF及其联接基金基金经理，2012年5月7日至今任本基金基金经理。杨宇先生对指数基金的投资管理、风险控制、指数化交易等方面具备丰富的投资管理经验。
张宏民先生，毕业于西安电子科技大学电子工程系，本科学历。11年证券基金从业经历，具有基金从业资格。2000年10月加入嘉实基金管理有限公司，在研究部从事定量研究工作。2008年起任公司结构产品投资部高级数量分析师，从事指数化投资管理与研究工作。2010年9月30日至今任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理，2012年5月7日至今任本基金基金经理。

（二）基金托管人

1、公司概况
名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
变更注册登记日期：2004年8月26日
注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人：肖钢
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管及投资者服务部总经理：李爱华
托管部门联系人：唐州徽
电话：010-66594855
传真：010-66594942
2.主要人员情况
中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工120余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。
目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。
3. 基金托管业务经营情况
截至2012年3月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选或号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证500指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板300成长交易型开放式指数、国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）、长盛环球景气行业大盘精选股票型（QDII）、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型（QDII）、信诚金砖四国积极配置（QDII）、海富通大中华精选股票型（QDII）、招商标普金砖四国指数（LOF-QDII）、华宝兴业成熟市场动量优选（QDII）、大成标普500等权重指数（QDII）、长信标普100等权重指数（QDII）、博时抗通胀增强回报（QDII）、华安大中华升级股票型（QDII）、信诚全球商品主题（QDII）、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型（QDII）等147只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。
（三）基金验资机构
名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
法定代表人：杨绍信
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海卢湾区湖滨路202号普华永道中心11楼
经办注册会计师：汪棣、吴海霞
电话：021-23238888
传真：021-23238800

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产列支，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。
本基金认购后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金2012年5月21日资产负债表（未经审计）如下：

资 产	期末 2012年5月21日
资 产：	
银行存款	272,020,290.24
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	18,602,929,465.08
其中：股票投资	18,602,929,465.08
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	994,125.58
应收股利	4,002,661.76
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	1,016,946.21
资产总计	18,880,963,488.87
负债和所有者权益	期末 2012年5月21日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	44,539,183.36
应付赎回款	-
应付管理人报酬	3,646,571.12
应付托管费	729,314.21
应付销售服务费	-
应付交易费用	12,540,276.36
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	228,862.03
递延所得税负债	-
负债合计	61,684,207.08
所有者权益：	
实收基金	19,333,307,392.00
未分配利润	-514,028,110.21
所有者权益合计	18,819,279,281.79
负债和所有者权益总计	18,880,963,488.87

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2012年5月21日，嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金的投资组合如下：

（一）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	18,602,929,465.08	98.53
	其中：股票	18,602,929,465.08	98.53
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	272,020,290.24	1.44
6	其他资产	6,013,733.55	0.03
7	合计	18,880,963,488.87	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

1. 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	114,569,686.08	0.61
B	采掘业	2,087,583,992.83	11.09
C	制造业	6,618,914,831.13	35.17
C0	食品、饮料	1,407,585,822.83	7.48
C1	纺织、服装、皮毛	58,042,806.96	0.31
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	342,793,546.53	1.82
C5	电子	204,177,721.25	1.08
C6	金属、非金属	1,636,467,565.39	8.70
C7	机械、设备、仪表	2,140,836,134.53	11.38
C8	医药、生物制品	811,192,601.72	4.31
C99	其他制造业	17,818,631.92	0.09
D	电力、煤气及水的生产和供应业	435,168,171.76	2.31
E	建筑业	526,642,437.80	2.80
F	交通运输、仓储业	581,066,705.41	3.09
G	信息技术业	561,546,322.36	2.98
H	批发和零售贸易	518,737,092.44	2.76
I	金融、保险业	5,669,014,176.76	30.12
J	房地产业	958,168,549.21	5.09
K	社会服务业	157,233,395.97	0.84
L	传播与文化产业	40,592,542.34	0.22
M	综合类	333,691,560.99	1.77
	合计	18,602,929,465.08	98.85

2. 积极投资按行业分类的股票投资组合
2012年5月21日，本基金未持有积极投资股票。

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

1. 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	82,980,045	544,349,095.20	2.89
2	600036	招商银行	45,405,226	528,516,830.64	2.81
3	601318	中国平安	12,381,758	515,328,767.96	2.74
4	601328	交通银行	83,416,209	392,890,344.39	2.09
5	601166	兴业银行	27,688,497	373,240,939.56	1.98
6	600000	浦发银行	41,207,804	365,513,221.48	1.94
7	600519	贵州茅台	1,529,813	341,438,963.47	1.81
8	600030	中信证券	25,231,351	326,493,681.94	1.73
9	601088	中国神华	12,109,751	314,853,526.00	1.67
10	000002	万 科A	35,656,058	309,138,022.86	1.64

2. 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资明细
2012年5月21日，本基金未持有积极投资股票。

（四）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
2012年5月21日本基金未持有权证。

（五）按债券品种分类的债券投资组合
2012年5月21日，本基金未持有债券。

（六）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
2012年5月21日，本基金未持有债券。

（七）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
2012年5月21日，本基金未持有资产支持证券。

（八）投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。
2、本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
3、2012年5月21日其他资产构成：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	4,002,661.76
4	应收利息	994,125.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,016,946.21
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,013,733.55

4、2012年5月21日持有的处于转股期的可转换债券明细
2012年5月21日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、2012年5月21日前十名股票中存在流通受限情况的说明
1）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
2012年5月21日，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。
2）期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
2012年5月21日，本基金未持有积极投资股票。

九、重大事件揭示

嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同已于2012年5月7日正式生效，基金管理人于2012年5月8日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站刊登《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告》。

嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金的申购、赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间内开始办理。本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，但在基金申请上市期间，可暂停办理申购、赎回。具体申购、赎回业务办理时间在申购、赎回开始公告中规定。基金管理人在开始办理申购赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

本基金自合同生效至本公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

（一）中国证监会核准嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
（二）《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
（三）《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
（四）《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
（五）《关于嘉实基金管理有限公司募集设立嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书》；
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；
（八）中国证监会要求的其他文件。

嘉实基金管理有限公司
2012年5月23日

附件：基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务
1、基金份额持有人的权利与义务
（1）基金份额持有人的权利
1）分享基金资产收益；
2）参与分配清算后的剩余基金资产；
3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
4）按照规定要求召开或自行召集基金份额持有人大会；
5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
7）监督基金管理人的投资运作；
8）对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
9）法律法规、基金合同规定的其他权利。
（2）基金份额持有人的义务
1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2）缴纳基金认购款项和认购股票、应付申购对价和赎回对价及基金合同规定的费用；
3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
4）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
5）不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
6）执行基金份额持有人大会的决议；
7）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
8）遵守基金管理人、销售机构和登记结算机构的相关交易及业务规则；
9）法律法规及基金合同规定的其他义务。
2、基金管理人的权利与义务
（1）基金管理人的权利
1）依法募集基金，办理基金备案手续；
2）依照法律法规和基金合同独立管理运用基金资产；
3）根据法律法规、基金合同、相关证券交易所及登记结算机构相关业务规则的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、收益分配等方面的业务规则；
4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
5）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
6）在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金资产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
7）选择、更换基金代销机构，如果基金管理人认为基金代销机构的作为或不作为违反了法律法规、基金合同或基金销售代理协议，基金管理人有权依据法律法规规定、基金合同、基金销售代理协议采取相应救济措施，以保护基金财产的安全和基金相关当事人的利益；
8）自行担任基金登记结算机构或选择、更换基金登记结算机构，办理基金登记结算业务，并按照基金合同规定对基金登记结算机构进行必要的监督和检查；
9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券和参与转融通；
11）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
13）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
14）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
15）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
16）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
17）法律法规、基金合同规定的其他权利。
（2）基金管理人的义务
1）依法申请并募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2）办理基金备案手续；
3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金资产；
5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；
6）按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
7）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；
8）进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
9）依法接受基金托管人的监督；
10）编制季度、半年度和年度基金报告；
11）采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；
12）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；
13）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
14）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
15）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购或赎回之基金份额的对价；
16）保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
17）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
18）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
19）组织并参加基金资产清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
20）因违反基金合同导致基金资产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21）基金托管人违反基金合同造成基金资产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。
3、基金托管人的权利与义务
（1）基金托管人的权利
1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金资产；
2）依照基金合同的约定获得基金托管费；
3）监督基金管理人对本基金的投资运作；
4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
6）法律法规、基金合同规定的其他权利。
（2）基金托管人的义务
1）安全保管基金资产；
2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
3）按规定开设基金资产的资金账户和证券账户；
4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金资产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金资产；
5）对所托管的不同基金资产分别设置账户，确保基金资产的完整和独立；
6）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
7）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
8）按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；
9）保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人