嘉实深证基本面300指数证券交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2012 第二季度 报告

2012年6月30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
报告送出日期：2012年7月18日

§1 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2012年7月18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2012年4月1日起至2012年6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	嘉实深证基本面300指数联接
基金主代码	160706
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月7日
报告期末基金份额总额	390,000,000.00份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金，主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。
业绩比较基准	深证基本面300指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为深证基本面300指数的联接基金，其业绩表现与深证基本面300指数及深证基本面300指数的表现密切相关，长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

2.2 目标基金基本情况

基金名称	深证基本面300指数交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159306
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009年4月7日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2009年4月13日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司
目标基金投资目标	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。
目标基金投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
目标基金业绩比较基准	深证基本面300指数
目标基金风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年4月1日-2012年6月30日）
1.本期已实现收益	5,000,000.00
2.本期利润	4,500,000.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0115
4.期末基金资产净值	390,000,000.00
5.期末基金份额净值	1.000

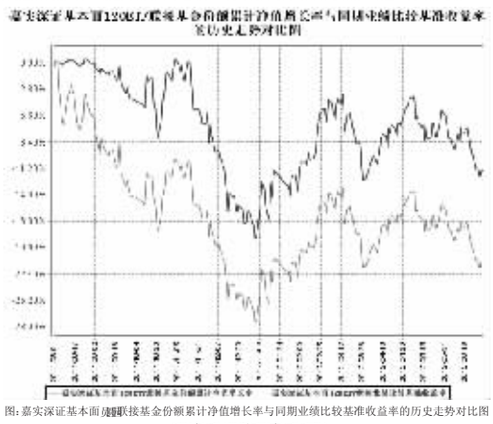
注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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	1.000%	0.000%	1.000%	0.000%	0.000%	0.000%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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300指数联接基金份额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
（2009年4月7日至2012年6月30日）

注：本基金基金合同生效日2009年4月7日至报告期末未满员年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起满6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、投资组合”（二）投资范围和（八）投资组合比例限制”的有关约定。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨阳	本基金、嘉实基本面300指数（LOF）、嘉实深证基本面300指数联接、嘉实黄金（QDII）基金经理	2011年8月3日		5年	曾任贝尔斯登高级工程师，5年投资公司高级工程师或交易操盘手，恒泰证券股份有限公司高级数量分析师，高盛集团高级数量分析师。2011年8月加入嘉实基金任高级数量分析师。宾夕法尼亚州立大学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。

注：(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日；(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业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规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、嘉实深证基本面300指数证券投资基金联接基金募集的文件；

(1) 中国证监会批准嘉实深证基本面300指数证券投资基金联接基金募集的文件；
(2) 嘉实深证基本面300指数证券投资基金联接基金合同；
(3) 嘉实深证基本面300指数证券投资基金联接基金招募说明书；
(4) 嘉实深证基本面300指数证券投资基金联接基金托管协议；
(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
(6) 报告期内嘉实深证基本面300指数证券投资基金联接基金公告的各项原稿。

4.3 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦6层嘉实基金管理有限公司

4.4 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日8:00-17:00，投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。
(2) 网站查询：基金管理人网址：www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话400-600-8800或发电子邮件，标题为“基金管理人对报告期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。

4.5.2 报告期内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。

4.5.3 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。

4.5.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	100,000.00
2	应收证券清算款	5,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,000.00
5	应收申购款	500,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	5,601,000.00

4.5.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

4.5.6 报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不在流通受限情况。

§5 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	390,000,000.00
本报告期基金总申购份额	0.00
减：本报告期基金总赎回份额	0.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	390,000,000.00

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§6 备查文件目录

(1) 中国证监会批准嘉实深证基本面300指数证券投资基金联接基金募集的文件；
(2) 嘉实深证基本面300指数证券投资基金联接基金合同；
(3) 嘉实深证基本面300指数证券投资基金联接基金招募说明书；
(4) 嘉实深证基本面300指数证券投资基金联接基金托管协议；
(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
(6) 报告期内嘉实深证基本面300指数证券投资基金联接基金公告的各项原稿。

6.2 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦6层嘉实基金管理有限公司

6.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日8:00-17:00，投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。
(2) 网站查询：基金管理人网址：www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话400-600-8800或发电子邮件，标题为“基金管理人对报告期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。

嘉实基金管理有限公司
2012年7月18日

嘉实沪深300指数证券投资基金（LOF）

2012 第二季度 报告

2012年6月30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
报告送出日期：2012年7月18日

§1 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2012年7月18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2012年4月1日起至2012年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实沪深300指数（LOF）
基金主代码	160706
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月7日
报告期末基金份额总额	300,000,000.00份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%，以实现对沪深300指数的有效跟踪，谋求通过中国证券市场来分享中国经济持续、稳定、快速发展的成果。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数增长率×95%+银行同业存款收益率×5%
风险收益特征	风险中等，获得证券市场平均收益率。
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

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年4月1日-2012年6月30日）
1.本期已实现收益	5,000,000.00
2.本期利润	4,500,000.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0115
4.期末基金资产净值	300,000,000.00
5.期末基金份额净值	1.000

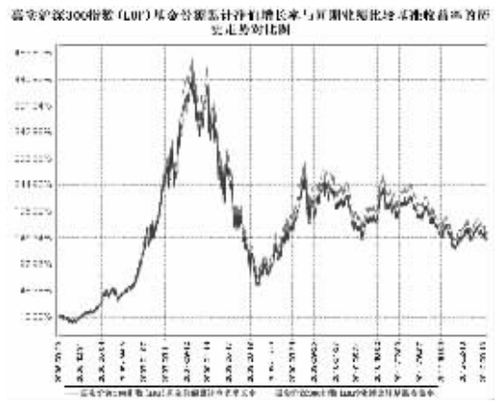
注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率与其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率标准差于	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差榆	梁辰龙	于瀚
过去三个月	0.000%	0.000%	0.000%	0.000%	0.000%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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：嘉实沪深300指数（LOF）基金份额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（2009年4月7日至2012年6月30日）

注：按基金合同约定，本基金自基金合同生效起6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第十七条（二）投资范围和（七）投资禁止行为与限制）的规定：

(1)基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；(2)原则上将不低于80%的基金资产净值投资于沪深300指数成份股和各选成份股，其中各选成份股投资比例不高于20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。 (3)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨宇	本基金基金经理、嘉实中创300指数证券投资基金、嘉实中创300指数联接、嘉实沪深300指数证券投资基金基金经理、公司结构产品投资部总监	2009年4月7日		原5年	曾先后担任平安保险投资管理中心基金交易室主任及天同基金管理有限公司投资部总经理、万家（天同）沪深300指数基金经理。2009年4月加入嘉实基金，南开大学经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。

注：(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日；(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业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规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、嘉实沪深300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和运用基金资产，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有关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

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易行为。

4.3.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.3.3.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金日均跟踪误差为0.[illegible]%，年度化拟合偏离度为0.[illegible]%，符合本基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.35%的限制。

4.3.3.2 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1.000元；本报告期基金份额净值增长率为0.00%，业绩比较基准收益率为0.00%。

4.3.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于沪深300指数的被动投资管理产品，我们将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争进一步降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的沪深300指数的投资工具。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	0.00	0.00%
	其中：股票	0.00	0.00%
2	固定收益投资	0.00	0.00%
	其中：债券	0.00	0.00%
	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	0.00	0.00%
6	其他资产	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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	-	-
B	采掘业	0.00	0.00%
C	制造业	0.00	0.00%
C0	食品、饮料	0.00	0.00%
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5	电子	0.00	0.00%
C6	金属、非金属	0.00	0.00%
C7	机械、设备、仪表	0.00	0.00%
C8	医药、生物制品	0.00	0.00%
C99	其他制造业	0.00	0.00%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E	建筑业	0.00	0.00%
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00%
G	信息技术业	0.00	0.00%
H	批发和零售贸易	0.00	0.00%
I	金融、保险业	0.00	0.00%
J	房地产业	0.00	0.00%
K	社会服务业	0.00	0.00%
L	传播与文化产业	0.00	0.00%
M	综合类	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

5.3 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.4.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	601318	中国平安	0.00	0.00	0.00%
2	601166	兴业银行	0.00	0.00	0.00%
3	600036	招商银行	0.00	0.00	0.00%
4	601328	交通银行	0.00	0.00	0.00%
5	600519	贵州茅台	0.00	0.00	0.00%
6	000001	平安银行	0.00	0.00	0.00%
7	600000	浦发银行	0.00	0.00	0.00%
8	600030	中信证券	0.00	0.00	0.00%
9	000651	格力电器	0.00	0.00	0.00%
10	000002	万科A	0.00	0.00	0.00%

注：根据本基金基金合同的约定，本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法。原则上将不低于80%的基金资产净值投资于沪深300指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于20%。

5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	0.00	0.00%
2	央行票据	0.00	0.00%
3	金融债券	0.00	0.00%
	其中：政策性金融债	0.00	0.00%
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	0.00	0.00%

5.6 报告期末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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	0000000	无开放证券	0.00	0.00	0.00%
2	0000000	无开放证券	0.00	0.00	0.00%
3	0000000	无开放证券	0.00	0.00	0.00%
4	0000000	无开放证券	0.00	0.00	0.00%
5	0000000	无开放证券	0.00	0.00	0.00%

5.7 报告期末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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

5.8 报告期末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

报告期末，本基金未持有权证。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	100,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,000.00
5	应收申购款	500,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	600,000.00

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	300,000,000.00
本报告期基金总申购份额	0.00
减：本报告期基金总赎回份额	0.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	300,000,000.00

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

(1) 中国证监会批准嘉实沪深300指数证券投资基金（LOF）募集的文件；
(2) 嘉实沪深300指数证券投资基金（LOF）基金合同；
(3) 嘉实沪深300指数证券投资基金（LOF）招募说明书；
(4) 嘉实沪深300指数证券投资基金（LOF）基金托管协议；
(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
(6) 报告期内嘉实沪深300指数证券投资基金（LOF）公告的各项原稿。

7.2 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦6层嘉实基金管理有限公司

7.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日8:00-17:00，投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。
(2) 网站查询：基金管理人网址：www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话400-600-8800或发电子邮件，标题为“基金管理人对报告期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。

嘉实基金管理有限公司
2012年7月18日

嘉实黄金证券投资基金（QDII）

2012 第二季度 报告

2012年6月30日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2012年7月18日

§1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年7月18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2012年4月1日起至2012年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实黄金（QDII）
基金主代码	160719
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月7日
报告期末基金份额总额	500,000,000.00份
投资目标	本基金主要投资于境外市场以实物黄金为支持的交易所交易基金等金融工具，通过严格的投资纪律的束和数量化的风险管理手段，力争实现对国际市场黄金价格走势的有效跟踪。
投资策略	本基金主要通过投资于海外市场跟踪黄金价格的交易所交易基金（ETF），以实现对黄金价格的有效跟踪，所投资的海外市场黄金ETF将以有实物黄金支持的金融工具为主，具体包括：(1)资产组合管理策略；本基金遴选出在全球发达市场上市的有实物黄金支持的优质黄金ETF；基本上采取买入持有的投资策略；(2)现金管理策略；(3)衍生品投资策略。
业绩比较基准	经汇率调整后的伦敦金价格
风险收益特征	本基金属于基金中基金（FoF）基金的表现与黄金价格走势直接相关，预期收益可能长期超过或低于股票、债券等传统金融资产。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
境外资产托管人	英文名称：Citibank N.A.（花旗银行纽约分行） 中文名称：纽约梅隆银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年4月1日-2012年6月30日）
1.本期已实现收益	5,000,000.00
2.本期利润	4,500,000.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0115
4.期末基金资产净值	500,000,000.00
5.期末基金份额净值	1.000

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)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率与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	1.000%	0.000%	1.000%	0.000%	0.000%	0.000%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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：嘉实黄金（QDII）基金份额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
（2009年4月7日至2012年6月30日）

注：本基金基金合同生效日2009年4月7日至报告期末未满员年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起远个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二、投资范围和（六）投资限制（二）投资组合限制）的有关约定。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨阳	本基金、嘉实基本面300指数（LOF）、嘉实深证基本面300指数联接、嘉实深证基本面300指数联接基金经理	2011年8月3日		原5年	曾任贝尔斯登高级工程师，5年投资公司高级工程师或交易操盘手，恒泰证券股份有限公司高级数量分析师，高盛集团高级数量分析师。2011年8月加入嘉实基金任高级数量分析师。宾夕法尼亚州立大学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。

注：(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日；(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业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规守信情况说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、嘉实黄金证券投资基金（QDII）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和运用基金资产，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有关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

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易行为。

4.3.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.3.3.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金日均跟踪误差为0.[illegible]%，年度化拟合偏离度为0.[illegible]%，符合本基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.35%的限制。

4.3.3.2 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1.000元；本报告期基金份额净值增长率为0.00%，业绩比较基准收益率为0.00%。

4.3.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们依旧保持对黄金的长期看涨，世界经济复苏的曲折，欧债问题的悬而未决，世界局势的持续动荡，都更加突出了黄金作为天然避险品种，其所具有的重金属和货币的双重属性投资品种，都决定其在投资组合中的重要地位。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	0.00	0.00%
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	0.00	0.00%
8	其他资产	0.00	0.00%
9	合计	0.00	0.00%

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

报告期末，本基金未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

报告期末，本基金未持有股票及存托凭证。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

报告期末，本基金未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

5.6 报告期末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

报告期末，本基金未持有债券。

5.7 报告期末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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

5.8 报告期末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

报告期末，本基金未持有权证。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	0.00
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	0.00

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有可转换债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	500,000,000.00
本报告期基金总申购份额	0.00
减：本报告期基金总赎回份额	0.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	500,000,000.00

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

(1) 中国证监会批准嘉实黄金证券投资基金（QDII）募集的文件；
(2) 嘉实黄金证券投资基金（QDII）基金合同；
(3) 嘉实黄金证券投资基金（QDII）托管协议；
(4) 嘉实黄金证券投资基金（QDII）招募说明书；
(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
(6) 报告期内嘉实黄金证券投资基金（QDII）公告的各项原稿。

7.2 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦6层嘉实基金管理有限公司

7.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日8:00-17:00，投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。
(2) 网站查询：基金管理人网址：www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉