

嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

2012 第三季度 报告

2012年9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

§1 重要提示
基金管理人的董事会及董事对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。

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 基金产品概况
2.1 基金产品概况
基金名称:嘉实沪深300ETF联接(LOF)

基金运作方式:上市型开放式
基金合同生效日:2005年8月29日

报告期末基金份额总额:41,277,175,427.27份

投资策略:本基金主要投资于国内证券市场,通过严谨的投资流程和数量化的风险控制手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.3%,跟踪误差小于1.0%。

业绩比较基准:95%的沪深300指数增长率加5%的银行活期存款利率

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
主要财务指标 报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)

1.本期已实现收益 -3,675,987,022.88
2.本期利润 -1,650,852,677.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0398
4.期末基金资产净值 25,421,991,079.99

5.期末基金份额净值 0.6159

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 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较
阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差

过去三个月 -6.10% 1.13% -6.49% 1.13% 0.39% 0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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
嘉实沪深300ETF联接(LOF)基金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

图:嘉实沪深300ETF联接(LOF)基金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
005年8月29日至2012年9月30日

注:根据2012年8月21日中国证监会《关于核准嘉实沪深300指数证券投资基金40F基金份额持有人大会决议的公告》,自2012年8月21日起,本基金管理人更名为嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF),本基金自2012年8月21日起3个月内为建仓期,期间持有的沪深300指数成份股,将逐步调整为嘉实沪深300ETF,本报告期末仍处于建仓期。

§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

杨宇 本基金、嘉实中证400ETF、嘉实沪深300ETF、嘉实中证红利ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证800ETF、嘉实中证红利ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证800ETF

注:①任职日期指基金合同生效之日;②证券从业的含通过从业资格(证券从业资格)和基金从业资格的相关工作经历。

4.2 管理人报告期内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守《证券投资基金法》及其他各项法律法规、中国证监会《证券投资基金管理运作办法》和《证券投资基金销售管理办法》,以及中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》,恪尽职守,勤勉尽责,没有出现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,本基金管理人严格执行《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,各投资组合均严格执行公平交易制度,不存在因公平交易制度执行不力而导致的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易的专项说明
报告期内,本基金管理人严格执行《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,各投资组合均严格执行公平交易制度,不存在因公平交易制度执行不力而导致的不公平交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他各项法律法规、中国证监会《证券投资基金管理运作办法》和《证券投资基金销售管理办法》,以及中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》,恪尽职守,勤勉尽责,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.2 报告期内基金业绩表现的说明
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他各项法律法规、中国证监会《证券投资基金管理运作办法》和《证券投资基金销售管理办法》,以及中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》,恪尽职守,勤勉尽责,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 报告期内基金资产组合情况
4.5.1 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.2 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.3 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.4 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.5 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.6 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.7 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.8 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.9 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.10 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.11 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.12 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.13 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.14 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.15 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.16 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.17 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.18 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.19 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.20 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.21 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.22 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.23 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.24 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.25 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.26 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.27 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.28 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.29 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.30 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.31 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.32 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.33 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.34 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.35 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.36 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.37 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.38 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.39 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.40 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.41 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.42 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.43 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

嘉实全球房地产证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年9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

§1 重要提示
基金管理人的董事会及董事对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。

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 基金产品概况
2.1 基金产品概况
基金名称:嘉实全球房地产(QDII)

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2012年7月24日

报告期末基金份额总额:90,709,266.70份

投资策略:本基金主要投资于全球房地产市场,在严格控制投资风险和保障资产流动性的基础上,力争长期、持续稳定地实现超越业绩比较基准的投资目标。

业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为:FTSE EPRA/NAREIT Developed REITs Total Return Index, 经汇率调整后,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
主要财务指标 报告期(2012年7月24日至2012年9月30日)

1.本期已实现收益 1,570,533.72
2.本期利润 485,972.87

3.加权平均基金份额本期利润 0.0010
4.期末基金资产净值 90,161,572.98

5.期末基金份额净值 0.994

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 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较
阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差

过去三个月 -0.60% 0.29% 3.00% 0.50% -3.60% -0.21%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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
嘉实全球房地产(QDII)基金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

图:嘉实全球房地产(QDII)基金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
012年7月24日至2012年9月30日

注:本基金基金合同生效以来,截至本报告期末,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他各项法律法规、中国证监会《证券投资基金管理运作办法》和《证券投资基金销售管理办法》,以及中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》,恪尽职守,勤勉尽责,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

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

蔡德森 本基金基金经理 2012年7月24日 - 11年

注:①任职日期指基金合同生效之日;②证券从业的含通过从业资格(证券从业资格)和基金从业资格的相关工作经历。

4.2 管理人报告期内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守《证券投资基金法》及其他各项法律法规、中国证监会《证券投资基金管理运作办法》和《证券投资基金销售管理办法》,以及中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》,恪尽职守,勤勉尽责,没有出现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,本基金管理人严格执行《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,各投资组合均严格执行公平交易制度,不存在因公平交易制度执行不力而导致的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易的专项说明
报告期内,本基金管理人严格执行《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,各投资组合均严格执行公平交易制度,不存在因公平交易制度执行不力而导致的不公平交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他各项法律法规、中国证监会《证券投资基金管理运作办法》和《证券投资基金销售管理办法》,以及中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》,恪尽职守,勤勉尽责,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.2 报告期内基金业绩表现的说明
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他各项法律法规、中国证监会《证券投资基金管理运作办法》和《证券投资基金销售管理办法》,以及中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》,恪尽职守,勤勉尽责,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 报告期内基金资产组合情况
4.5.1 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.2 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.3 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.4 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.5 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.6 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.7 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.8 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.9 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.10 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.11 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.12 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.13 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.14 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.15 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.16 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.17 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.18 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.19 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.20 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.21 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.22 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.23 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.24 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.25 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.26 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.27 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.28 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.29 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.30 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.31 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.32 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.33 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.34 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.35 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.36 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.37 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.38 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.39 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.40 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.41 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.42 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.43 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

嘉实优化红利股票型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年9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

§1 重要提示
基金管理人的董事会及董事对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。

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 基金产品概况
2.1 基金产品概况
基金名称:嘉实优化红利股票

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2012年6月26日

报告期末基金份额总额:169,930,225.07份

投资策略:本基金主要投资于国内证券市场,通过严谨的投资流程和数量化的风险控制手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.3%,跟踪误差小于1.0%。

业绩比较基准:中证红利指数收益率*95%+上证国债指数收益率*5%

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
主要财务指标 报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)

1.本期已实现收益 4,965,203.43
2.本期利润 -1,266,728.85

3.加权平均基金份额本期利润 -0.00900
4.期末基金资产净值 167,743,715.79

5.期末基金份额净值 0.987

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 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较
阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差

过去三个月 -1.30% 0.94% -0.95% 1.07% 4.65% -0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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
嘉实优化红利股票型证券投资基金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

图:嘉实优化红利股票型证券投资基金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
012年6月26日至2012年9月30日

注:本基金基金合同生效以来,截至本报告期末,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他各项法律法规、中国证监会《证券投资基金管理运作办法》和《证券投资基金销售管理办法》,以及中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》,恪尽职守,勤勉尽责,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

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

郭志浩 本基金基金经理 2012年6月26日 - 5年

注:①任职日期指基金合同生效之日;②证券从业的含通过从业资格(证券从业资格)和基金从业资格的相关工作经历。

4.2 管理人报告期内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守《证券投资基金法》及其他各项法律法规、中国证监会《证券投资基金管理运作办法》和《证券投资基金销售管理办法》,以及中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》,恪尽职守,勤勉尽责,没有出现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,本基金管理人严格执行《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,各投资组合均严格执行公平交易制度,不存在因公平交易制度执行不力而导致的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易的专项说明
报告期内,本基金管理人严格执行《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,各投资组合均严格执行公平交易制度,不存在因公平交易制度执行不力而导致的不公平交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他各项法律法规、中国证监会《证券投资基金管理运作办法》和《证券投资基金销售管理办法》,以及中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》,恪尽职守,勤勉尽责,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.2 报告期内基金业绩表现的说明
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他各项法律法规、中国证监会《证券投资基金管理运作办法》和《证券投资基金销售管理办法》,以及中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》,恪尽职守,勤勉尽责,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 报告期内基金资产组合情况
4.5.1 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.2 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.3 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.4 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.5 报告期末基金资产组合情况
截至2012年9月30日,本基金资产组合情况如下:

4.5.6 报告期末基金资产组合情况
截至2012年