# 中创400交易型开放式指数证券投资基金

## 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：中国工商银行股份有限公司**
**报告送出日期：2012年10月26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10月19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7月1日起至2012年9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 嘉实中创400ETF（场内简称：中创400） |
| 基金主代码 | 159918 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年3月22日 |
| 报告期末基金份额总额 | 265,561,264.00份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。 |
| 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。 |
| 业绩比较基准 | 中创400指数 |
| 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。 |
| 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 |

### §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7月1日－2012年9月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -869,339.17 |
| 2.本期利润 | -17,329,099.48 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0641 |
| 4.期末基金资产净值 | 241,465,371.69 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9093 |

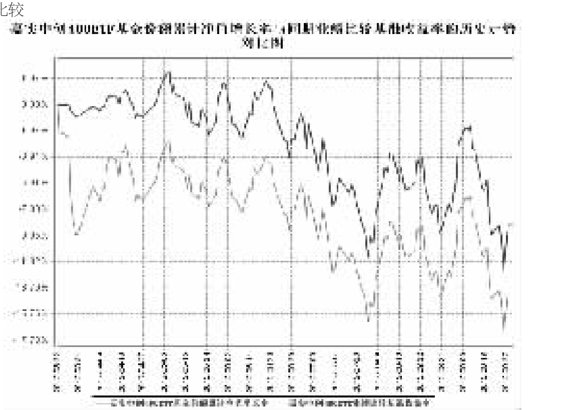
注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -6.60% | 1.56% | -6.47% | 1.57% | -0.13% | -0.01% |

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：嘉实中创400ETF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

（2012年3月22日至2012年9月30日）

注：本基金基金合同生效日2012年3月22日至报告期末未满1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“第十三部分二、投资范围和六、投资限制（一）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 | | |
| 杨宇 | 本基金、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实沪深300ETF基金经理、公司结构产品投资部总监 | 2012年3月22日 | - | 14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）180指数基金经理。2004年7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、《中创400交易型开放式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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 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0.02%，年度化拟合偏离度为0.25%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.2%的限制。

4.4.2 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0.9093元；本报告期基金份额净值增长率为-6.60%，业绩比较基准收益率为-6.47%。

4.5 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中创400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中创400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 | 240,170,789.95 | 99.21 |
| | 其中：股票 | 240,170,789.95 | 99.21 |
| 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 | 1,088,726.58 | 0.45 |
| 6 | 其他资产 | 815,712.42 | 0.34 |
| | 合计 | 242,075,228.95 | 100.00 |

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 | 4,525,371.27 | 1.87 |
| B | 采掘业 | 2,522,229.40 | 1.04 |
| C | 制造业 | 162,270,154.32 | 67.20 |
| C0 | 食品、饮料 | 9,440,237.22 | 3.91 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 7,516,819.03 | 3.11 |
| C2 | 木材、家具 | 1,828,694.32 | 0.76 |
| C3 | 造纸、印刷 | 4,316,371.39 | 1.79 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 27,532,307.89 | 11.40 |
| C5 | 电子 | 26,133,740.55 | 10.82 |
| C6 | 金属、非金属 | 20,557,474.65 | 8.51 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 43,101,811.21 | 17.85 |
| C8 | 医药、生物制品 | 17,042,372.62 | 7.06 |
| C99 | 其他制造业 | 4,800,325.44 | 1.99 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 1,808,319.14 | 0.75 |
| E | 建筑业 | 10,855,351.63 | 4.50 |
| F | 交通运输、仓储业 | 791,432.70 | 0.33 |
| G | 信息技术业 | 28,617,334.43 | 11.85 |
| H | 批发和零售贸易 | 10,782,212.87 | 4.47 |
| I | 金融、保险业 | - | - |
| J | 房地产业 | 2,680,187.55 | 1.11 |
| K | 社会服务业 | 10,108,520.02 | 4.19 |
| L | 传播与文化产业 | 4,916,543.50 | 2.04 |
| M | 综合类 | 293,133.12 | 0.12 |
| | 合计 | 240,170,789.95 | 99.46 |

5.2.2 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。

5.3 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

5.3.1 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 | 002375 | 亚厦股份 | 101,745 | 2,569,061.25 | 1.06 |
| 2 | 002250 | 联化科技 | 125,359 | 2,356,749.20 | 0.98 |
| 3 | 002570 | 贝因美 | 97,800 | 2,088,030.00 | 0.86 |
| 4 | 002477 | 雏鹰农牧 | 105,550 | 1,905,177.50 | 0.79 |
| 5 | 300058 | 蓝色光标 | 87,430 | 1,862,259.00 | 0.77 |
| 6 | 002344 | 海宁皮城 | 71,582 | 1,797,424.02 | 0.74 |
| 7 | 300146 | 汤臣倍健 | 30,406 | 1,611,822.06 | 0.67 |
| 8 | 300039 | 上海凯宝 | 63,807 | 1,500,102.57 | 0.62 |
| 9 | 002428 | 云南锗业 | 60,532 | 1,454,583.96 | 0.60 |
| 10 | 002311 | 海大集团 | 87,986 | 1,442,970.40 | 0.60 |

5.3.2 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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

5.5 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。

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 787,756.93 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 196.29 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | 27,759.20 |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 815,712.42 |

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

### §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 | 277,561,264.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 12,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 265,561,264.00 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

（1）中国证监会批准中创400交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
（2）《中创400交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
（3）《中创400交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
（4）《中创400交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议》；
（5）基金管理人业务资格批件、营业执照；
（6）报告期内中创400交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

7.2 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦8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8:30-11:30，13:00-17:30。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：http://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，E-mail：service@jsfund.cn。

**嘉实基金管理有限公司**
**2012年10月26日**

---

# 嘉实黄金证券投资基金（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：中国工商银行股份有限公司**
**报告送出日期：2012年10月26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10月19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7月1日起至2012年9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 嘉实黄金（QDII-FOF-LOF） |
| 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 | 2011年8月4日 |
| 报告期末基金份额总额 | 296,803,315.01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约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）ETF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，本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：The Bank of New York Mellon Corporation<br>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7月1日－2012年9月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -2,025,576.70 |
| 2.本期利润 | 27,272,897.73 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0882 |
| 4.期末基金资产净值 | 298,926,105.40 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.007 |

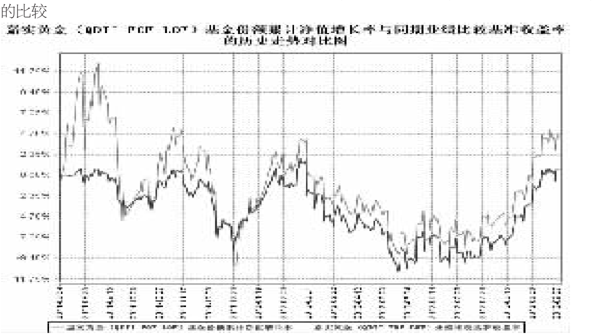
注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 9.69% | 0.64% | 11.39% | 0.89% | -1.70% | -0.25% |

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-FOF-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

（2011年8月4日至2012年9月30日）

注：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（十二（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50指数（LOF）、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接基金经理 | 2011年8月4日 | - | 12年 | 曾任贝尔斯登高级工程师，HBK投资公司高级工程师/交易操盘手，Citadel投资集团高级数量分析师，高盛集团高级数量分析师。2008年3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 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（LOF）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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在2012年三季度，国际市场黄金价格出现了一波明显的涨幅，从1600美元一路攀升到1770美元附近，再次逼近1800美元。其主要原因是美联储QE3的尘埃落定，欧洲央行率先无限量购买欧债，随后日本央行推出10万亿日元的量化宽松，全球量化宽松浪潮袭来推动黄金从新回到高位。虽然今年黄金走势经历几次跌宕起伏，但是没有改变黄金长期向上的走势。

本基金以跟踪国际市场金价走势是主要投资目标，在本季度保持了比较高的持仓，基金收益有效的反应了国际金价的走势。

4.4.2 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1.007元；本报告期基金份额净值增长率为9.69%，同期业绩比较基准收益率为11.39%。

4.5 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乐观的观点，其所天然具备的货币和贵金属的双重属性是其它投资品种不可替代的，随着美联储、欧洲央行以及日本央行量化宽松政策的推进执行，会进一步推动黄金的向上趋势。同时，黄金消费和投资者投资黄金的热情依旧高涨，从各国央行到个人对于黄金的投资以及消费的需求也支持黄金价格的进一步走高。

### §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 | 279,184,162.08 | 91.05 |
| 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 | 27,042,024.56 | 8.82 |
| 8 | 其他资产 | 406,809.88 | 0.13 |
| | 合计 | 306,632,996.52 | 100.00 |

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 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金融衍生品投资明细

报告期末，本基金未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | SPDR GOLD TRUST | ETF基金 | 交易型开放式 | World Gold Trust Services LLC | 52,229,762.24 | 17.47 |
| 2 | ISHARES GOLD TRUST | ETF基金 | 交易型开放式 | BlackRock Fund Advisors | 51,966,762.61 | 17.38 |
| 3 | JB PHYSICAL GOLD FUND | ETF基金 | 交易型开放式 | Swiss & Global Asset Management AG | 48,597,753.73 | 16.26 |
| 4 | ZKB GOLD ETF-A（USD） | ETF基金 | 交易型开放式 | Zuercher Kantonalbank | 43,234,294.97 | 14.46 |
| 5 | CSETF II ON GOLD | ETF基金 | 交易型开放式 | Credit Suisse Asset Management Funds | 43,183,326.02 | 14.45 |
| 6 | ETFS GOLD TRUST | ETF基金 | 交易型开放式 | ETF securities USA LLC | 39,972,262.51 | 13.37 |

注：报告期末，本基金仅持有上述6只基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

5.10.3 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 | 1,220.48 |
| 5 | 应收申购款 | 389,053.76 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | 16,535.64 |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 406,809.88 |

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有股票及存托凭证。

### §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 | 315,887,801.55 |
| 本报告期基金总申购份额 | 6,220,502.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 25,304,988.54 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 296,803,315.01 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

（1）中国证监会核准嘉实黄金证券投资基金（LOF）募集的文件；
（2）《嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金合同》；
（3）《嘉实黄金证券投资基金（LOF）托管协议》；
（4）《嘉实黄金证券投资基金（LOF）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（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8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8:30-11:30，13:00-17:30。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：http://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，E-mail：service@jsfund.cn。

**嘉实基金管理有限公司**
**2012年10月26日**

---

# 嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 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：中国工商银行股份有限公司**
**报告送出日期：2012年10月26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10月19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7月1日起至2012年9月30日止。

### §2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 嘉实中创400ETF联接 |
| 基金主代码 | 070030 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年3月22日 |
| 报告期末基金份额总额 | 228,363,507.85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，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。 |
| 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；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 | 中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为中创400ETF的联接基金，主要通过投资于中创400ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。本基金的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 | 中国工商银行股份有限公司 |

2.2 目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 中创400交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 159918 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年3月22日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2012年5月11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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 目标基金投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。 |
| 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 | 中创400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。 |

### §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7月1日－2012年9月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -996,010.76 |
| 2.本期利润 | -14,400,129.77 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0620 |
| 4.期末基金资产净值 | 208,839,044.24 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9145 |

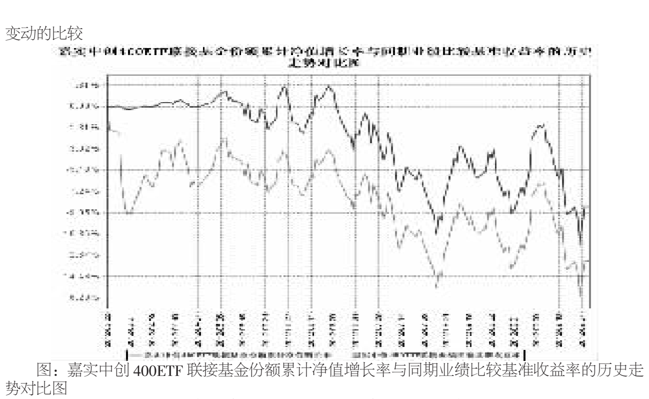
注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -6.27% | 1.48% | -6.11% | 1.49% | -0.16% | -0.01% |

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：嘉实中创400ETF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

（2012年3月22日至2012年9月30日）

注：本基金基金合同生效日2012年3月22日至报告期末未满1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“第十一部分二、投资范围和六、投资限制（一）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 | | |
| 杨宇 | 本基金、嘉实中创400ETF、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实沪深300ETF基金经理、公司结构产品投资部总监 | 2012年3月22日 | - | 14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）180指数基金经理。2004年7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、《嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 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0.02%，年度化拟合偏离度为0.35%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.35%的限制。

4.4.2 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0.9145元；本报告期基金份额净值增长率为-6.27%，业绩比较基准收益率为-6.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为嘉实中创400ETF的联接基金，遵循指数化投资理念，通过投资于嘉实中创400ETF、中创400指数成份股和备选成份股等，力求获得与嘉实中创400ETF所跟踪的中创400指数相近的平均收益率。本基金作为一只间接投资于中创400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。

### §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 | 5,448,136.14 | 2.60 |
| | 其中：股票 | 5,448,136.14 | 2.60 |
| 2 | 基金投资 | 191,193,916.75 | 91.29 |
| 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 | - | - |
| 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 | 银行存款和结算备付金合计 | 12,192,021.77 | 5.82 |
| 7 | 其他资产 | 598,951.65 | 0.29 |
| | 合计 | 209,433,026.31 | 100.00 |

5.2 报告期末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 | 103,324.00 | 0.05 |
| B | 采掘业 | 55,715.00 | 0.03 |
| C | 制造业 | 3,674,386.08 | 1.76 |
| C0 | 食品、饮料 | 211,902.50 | 0.10 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 175,106.00 | 0.08 |
| C2 | 木材、家具 | 39,983.00 | 0.02 |
| C3 | 造纸、印刷 | 96,678.00 | 0.05 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 615,407.18 | 0.29 |
| C5 | 电子 | 596,632.20 | 0.29 |
| C6 | 金属、非金属 | 462,352.00 | 0.22 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 978,690.12 | 0.47 |
| C8 | 医药、生物制品 | 388,356.08 | 0.19 |
| C99 | 其他制造业 | 109,279.00 | 0.05 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 40,427.00 | 0.02 |
| E | 建筑业 | 241,637.80 | 0.12 |
| F | 交通运输、仓储业 | 18,078.00 | 0.01 |
| G | 信息技术业 | 651,684.66 | 0.31 |
| H | 批发和零售贸易 | 242,565.00 | 0.12 |
| I | 金融、保险业 | - | - |
| J | 房地产业 | 59,783.60 | 0.03 |
| K | 社会服务业 | 230,338.00 | 0.11 |
| L | 传播与文化产业 | 123,681.00 | 0.06 |
| M | 综合类 | 6,516.00 | 0.00 |
| | 合计 | 5,448,136.14 | 2.61 |

5.3 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

| 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 | 002375 | 亚厦股份 | 2,200 | 55,550.00 | 0.03 |
| 2 | 300058 | 蓝色光标 | 2,500 | 53,250.00 | 0.03 |
| 3 | 002250 | 联化科技 | 2,700 | 50,760.00 | 0.02 |
| 4 | 002570 | 贝因美 | 2,200 | 46,970.00 | 0.02 |
| 5 | 002477 | 雏鹰农牧 | 2,300 | 41,515.00 | 0.02 |
| 6 | 002344 | 海宁皮城 | 1,600 | 40,176.00 | 0.02 |
| 7 | 300146 | 汤臣倍健 | 700 | 37,107.00 | 0.02 |
| 8 | 002428 | 云南锗业 | 1,400 | 33,642.00 | 0.02 |
| 9 | 300039 | 上海凯宝 | 1,400 | 32,914.00 | 0.02 |
| 10 | 002456 | 欧菲光 | 900 | 32,463.00 | 0.02 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

5.5 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。

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

5.8 期末投资目标基金明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 嘉实中创400ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 嘉实基金管理有限公司 | 191,193,916.75 | 91.55 |

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 | 440,607.72 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,198.74 |
| 5 | 应收申购款 | 156,145.19 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 598,951.65 |

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存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

### §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 | 240,951,577.55 |
| 本报告期基金总申购份额 | 9,723,344.70 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 22,311,414.40 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 228,363,507.85 |

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

（1）中国证监会批准嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
（2）《嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
（3）《嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；
（4）《嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金托管协议》；
（5）基金管理人业务资格批件、营业执照；
（6）报告期内嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金公告的各项原稿。

7.2 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦8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8:30-11:30，13:00-17:30。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：http://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，E-mail：service@jsfund.cn。

**嘉实基金管理有限公司**
**2012年10月26日**