

## 嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)

## 2012第四季度报告

2012年12月31日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2013年1月21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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月15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全部内容，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。

本报告期止2012年10月1日至2012年12月31日止。

## §2基金产品概况

基金简称	嘉实恒生指数(QDII-LOF)
基金代码	160717
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月30日
报告期末基金份额总额	129,712,717.24份

本基金进行开放式指数化投资，通过严格的的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不高于0.3%，年跟踪误差不超过4%，以实现对恒生中国企业指数的有效跟踪，给投资者提供一个投资恒生企业中企标的指数化投资工具。

投资目标 本基金通过被动式指数化投资，按照成份股在恒生中国企业指数中的基础权重构建指数化投资组合。

投资策略 基金管理人将不直接购买股票，按照成份股在恒生中国企业指数中的基础权重构建指数化投资组合。

业绩比较基准 人民币计价的恒生中国企业指数

风险收益特征 较高风险、较高收益

基金管理人 嘉实基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

境外资产托管人 美国州立银行(State Street Bank & Trust Company)

中文名称 嘉实恒生指数证券投资基金

## §3主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -3,279,718.33

2.本期平均基金份额本期利润 13,387,678.39

3.加权平均基金份额本期利润 0.0989

4.期末基金资产净值 103,774,024.24

5.期末基金份额净值 0.8000

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，本期期间内已实现收益加上本期公允价值变动收益；②所述基金净值指标不包括持有人认购或交易产生的申购赎回费用，计算时已经扣除申购赎回费用。

③基金净值增长率=本期份额净值增长率为1.57%，业绩比较基准收益率为1.3%

④本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(%) 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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 14.04% 1.03% 15.33% 1.10% -1.29% -0.07%

3.2.1 本基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

历史走势对比图

2010年9月30日至2012年12月31日

注:按基金合同约定,本基金自基金首次开放日起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同规定的投资范围、类别和品种限制。

## §4管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	任本基金的基金经理	证券从业年限	说明
张宏民	本基金基金经理	2010年9月30日	-	11年	

注:①本基金的原基金经理在本基金合同生效之日,由证券从业的公司从行业从业人员资格管理办法》的相关规定。

②报告期内,本基金未使用新的证券代码作为代码。

③本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

④本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑤本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑥本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑦本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑧本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑨本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑩本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑪本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑫本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑬本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑭本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑮本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑯本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑰本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑱本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑲本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

⑳本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉑本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉒本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉓本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉔本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉕本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉖本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉗本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉘本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉙本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉚本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉛本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉜本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉝本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉞本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉟本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。

㉟本基金的原基金经理在本基金合同生效之日前6个月内未担任过基金经理。