

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF)

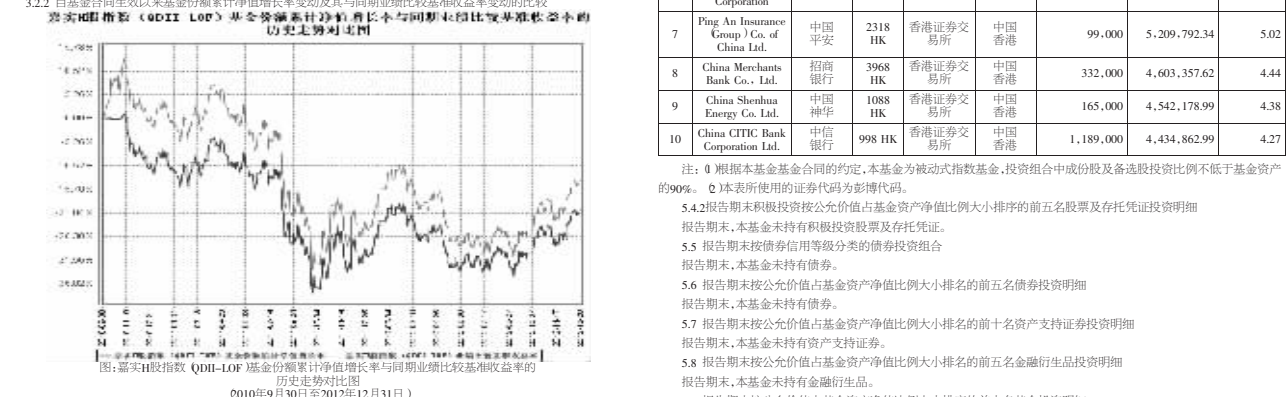
2012 第四季度 报告

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:中国工商银行股份有限公司 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。 基金托管人中国工商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,也不保证基金净值不受亏损,投资者须自行承担投资风险。 本报告中所列财务数据未经审计。 本报告自2012年10月1日起至2012年12月31日止。	
§2 基金产品概况	
基金简称	嘉实中恒指数 (QDII-LOF) (深交所上市简称:恒生H)
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
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,力争跟踪本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差小于0.3%,年跟踪误差不超过4%,以实现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中国企业指数的有效投资工具。
投资策略	本基金为被动式指数基金,按照成份股在恒生中国企业指数中的基准权重构建指数化投资组合。
业绩比较基准	人民币港币汇率×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	中国工商银行股份有限公司
英文名称:Sate Street Bank and Trust Company 中文名称:美国道富银行	

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.本期利润	13,387,478.39					
3.加权平均基金份额本期利润	0.0989					
4.期末基金资产净值	103,774,024.42					
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	14.04%	1.03%	15.33%	1.10%	-1.29%	-0.07%
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:嘉实中恒指数 (QDII-LOF) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比						

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	Bank of China Ltd	中国银行	3988 HK	香港证券交易所	中国香港	3,420,000	9,594,950.22	9.25
2	Industrial and Commercial Bank of China Ltd	工商银行	1398 HK	香港证券交易所	中国香港	2,143,000	9,557,083.53	9.21
3	Petco-China Co., Ltd	中国石化股份	857 HK	香港证券交易所	中国香港	1,022,000	9,099,091.93	8.77
4	China Life Insurance Co. Ltd.	中国人寿	2628 HK	香港证券交易所	中国香港	361,000	7,405,736.31	7.14
5	Bank of Communications Co., Ltd.	交通银行	3328 HK	香港证券交易所	中国香港	1,437,400	6,806,612.21	6.56
6	China Petroleum & Chemical	中国石化股份	386 HK	香港证券交易所	中国香港	814,000	5,795,080.08	5.58



注:按基金合同约定,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投资组合比例符合基金合同“十四、基金的投资”中“(C) 投资范围”、“(V) 投资组合比例限制”的规定。

4.1 基金经营 践基金小组 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
张安民	本基金基金经理	2010年9月30日	11年	2000年10月加入嘉实基金管理有限公司,在研究部从事宏观研究工作;2008年起任公司结构产品投资部高级数量分析师,从事量化投资组合管理与研究工作,大学本、科具有基金从业资格,中国国籍。
注:1.基金经理是指本基金基金经理之(C) 证券从业的含通过行业协会 证券业从业人员资格考试,取得基金从业资格,并符合中国证监会规定的其他条件。				
2.报告期内本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF) 基金合同》及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。本基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。				
4.2 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.1 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.2 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.3 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.4 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.5 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.6 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.7 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.8 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.9 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.10 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.11 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.12 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.13 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.14 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.15 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.16 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.17 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.18 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.19 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.20 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.21 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.22 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.23 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.24 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.25 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.26 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.27 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.28 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.29 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.30 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.31 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.32 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.33 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.34 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.35 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.36 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.37 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.38 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.39 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.40 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.41 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.42 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.43 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.44 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.45 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.46 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.47 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.48 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.49 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.50 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.51 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.52 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.53 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.54 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.55 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.56 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.57 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.58 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.59 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.60 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.61 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.62 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.63 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.64 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.65 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.66 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.67 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.68 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.69 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.70 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.71 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.72 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.73 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.74 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.75 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.76 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.77 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.78 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.79 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.80 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.81 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.82 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.83 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.84 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.85 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.86 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.87 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.88 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.89 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.90 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.91 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.92 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.93 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.94 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.95 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.96 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.97 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.98 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.99 基金管理人报告期内主要业绩				
4.2.100 基金管理人报告期内主要业绩				

5.10 投资组合报告摘要		
5.10.1 报告期内基金投资前十大重仓券的发行主体未受监管部门立案调查,在本报告编制日以前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受公开谴责、处罚。		
5.10.2 本基金投资的资产前十名证券中,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	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	32,607
6	其他应收款	45,355.49
7	待摊费用	-
8	其他	-
10	合计	45,676.16

5.10.4 报告期内持有的,于报告期末的可转债持仓明细

5.10.5 本基金未持有可转债持仓

5.10.6 报告期内前十名持仓券在流通受限情况的说明

5.10.7 报告期内前十名持仓券在流通受限情况的说明

5.10.8 本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.9 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.10 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.11 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.12 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.13 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.14 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.15 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.16 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.17 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.18 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.19 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.20 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.21 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.22 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.23 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.24 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.25 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.26 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.27 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.28 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.29 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.30 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.31 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.32 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.33 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.34 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.35 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.36 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.37 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.38 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.39 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.40 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.41 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.42 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.43 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.44 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.45 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.46 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.47 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.48 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.49 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.50 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.51 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.52 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.53 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.54 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.55 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.56 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.57 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.58 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.59 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.60 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.61 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.62 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.63 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.64 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.65 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.66 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.67 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.68 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.69 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.70 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.71 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.72 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.73 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.74 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.75 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.76 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.77 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.78 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.79 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.80 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.81 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.82 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.83 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.84 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.85 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.86 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.87 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.88 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.89 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.90 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.91 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.92 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.93 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.94 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.95 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.96 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.97 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.98 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.99 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

5.10.100 报告期内本基金本报告期末前十名持仓中不存在流通受限情况

本基金作为一只投资于香港恒生指数的被动投资资产管理产品,我们将继续采取指数化投资策略,积极对基金中可能影响对预期跟踪效果带来的冲击,力争进一步降低基金跟踪误差,给投资者提供一个标准化的香港恒生指数跟踪的投资工具。

§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 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	98,081,026.77	93.19
	其中:普通股	98,081,026.77	93.19
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
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	银行存款和清算备付金合计	7,124,754.21	6.77
8	其他资产	45,676.16	0.04
	合计	105,251,457.14	100.00

96 开放式基金资产变动		单位:元
本报告期初基金份额总额		141,025,434.76
本报告期基金已申购份额		3,955,735.16
本报告期基金已赎回份额		15,268,452.68
本报告期基金拆分变动份额		-
本报告期末基金份额总额		129,712,717.24

§7 备查文件目录

- 备查文件目录
- 中国证监会批准嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 QDII - LOF 募集的文件;
- 《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 QDII - LOF 基金合同》;
- 《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 QDII - LOF 招募说明书》;
- 《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 QDII - LOF 基金托管协议》;
- 基金管理人业务资格批复、营业执照;
- 报告期内嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 QDII - LOF 公告的各项原稿。
- 存放地点
- 北京市建国门大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司
- 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行投资托管服务部
- 查阅方式
- 书面查询:查阅时间为每日工作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。
- 网站查询:基金管理人网站 <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400-6800-8800,或发电子邮件:E-mail:service@jsfund.cn

嘉实基金管理有限公司
2013年1月21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: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。 基金托管人中国工商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,也不保证基金净值不受亏损,投资者须自行承担投资风险。 本报告中所列财务数据未经审计。 本报告自2012年10月1日起至2012年12月31日止。	
§2 基金产品概况	
基金简称	嘉实基本面50指数 (LOF) (深交所上市简称:嘉实50)
基金代码	160716
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月30日
报告期末基金份额总额	2,644,442,075.69份
投资目标	采用指数化投资策略,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,追求对标的指数的有效跟踪。
投资策略	采取完全复制策略,控制标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数的权重及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×95%+银行间存款收益率×5%
风险收益特征	本基金属于中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。
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

本报告自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实基本面50指数(LOF) (深交所上市简称:嘉实50)
基金代码	160716
基金运作方式	上市契约开放式
基金合同生效日	2009年12月30日
报告期末基金份额总额	2,644,442,055.69份

投资目标 采用指数化投资策略,通过严格的择时纪律和数量化的风险管理手段,追求对标的指数的有效跟踪。

投资策略 采用完全复制策略,跟踪标的指数的成份股及其权重构成投资组合,并根据标的指数权重及其成份股权重进行投资组合调整。

业绩比较基准 中证50 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%

风险收益特征 本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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

例外基金合同 十一(一) 3. 投资范围 和七(七) 基金投资组合限制 的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金业绩比较基准偏离度说明

姓名	职务	任本基金基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨阳	本基金、嘉实国际130ETF、嘉实国际130ETF-ESD、嘉实国际130ESD-100跟踪基金、嘉实国际130ETF-ESD跟踪基金	2009年12月30日	-	12年	曾任川尔森高级总工程师、HKB设计集团总工程师及项目经理、Galest设计集团项目经理。高级金融分析师。2006年3月加入嘉实基金任数量分析师,负责投资组合优化及风险管理。攻读芝加哥大学工商管理硕士学位,中国国籍。

注:①任职日期是指本基金基金合同生效之日;②离任日期为合同约定的终止日;③证券从业年限指基金从业人员资格管理方法所规定。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作跟踪情况的说明

报告期内,本基金管理人严格按照《基金合同》、《证券投资基金法》及其他各项法律法规、规章和证券基金行业自律性组织颁布的各项基金法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责、专业审慎、独立运作原则,严格执行基金合同,在严格控制



注:按基金合同约定,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“十四、基金的投资”中“(C) 投资范围”和“(V) 投资组合比例限制”的规定。

§4 管理人报告				
4.1 基金经营 践基金小组 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
杨阳	本基金、嘉实中证红利基金基金经理	2009年12月30日	12年	曾任贝尔斯登基金分析师,后加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2009年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2010年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2011年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2012年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2013年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2014年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2015年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2016年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2017年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2018年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2019年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2020年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2021年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2022年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2023年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2024年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2025年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2026年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2027年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2028年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2029年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2030年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2031年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2032年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2033年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2034年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2035年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2036年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;2037年12月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员;203