

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

重要提示
基金管理人承诺,基金管理人承诺不以虚假、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。

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年度 报告摘要

2012年12月31日

基金基本情况
基金名称:嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)
基金简称:嘉实沪深300
基金代码:160706

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
基金合同生效日期:2005年8月29日

基金投资组合
基金名称:嘉实沪深300ETF(场内简称:300ETF)
基金代码:159919

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
基金合同生效日期:2005年8月29日

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2013年,随着中国经济转型升级逐步推进,推动中国经济长期快速发展的基本要素仍然存在,所以我们依然坚定看好中国中长期发展前景,并继续采取积极的投资策略。

4.6 管理人报告期末基金资产组合情况的说明
报告期末,本基金管理人严格遵守《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定的基金合同的规定,正常运作由基金管理人及基金托管人一并履行,基金资产净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

4.7 管理人报告期末基金资产组合情况的说明
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.8 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.9 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.10 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.11 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.12 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.13 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.14 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.15 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.16 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.17 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.18 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.19 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.20 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.21 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

4.22 投资组合报告
(1)报告期末本基金资产配置情况的说明
(2)报告期末本基金资产配置情况的说明

7.4.4.3 与关联方银行间同业市场的债券(含回购)交易
单位:人民币元
本期
2012年1月1日至2012年12月31日

7.4.4.4 与关联方债券买卖的情况
7.4.4.4.1 报告期内与基金管理人运用固有资金投资债券的情况
单位:人民币元

7.4.4.4.2 报告期内与基金管理人运用固有资金投资债券的情况
单位:人民币元

7.4.4.4.3 与关联方银行间同业市场的债券(含回购)交易
单位:人民币元

7.4.4.4.4 与关联方债券买卖的情况
7.4.4.4.4.1 报告期内与基金管理人运用固有资金投资债券的情况
单位:人民币元

7.4.4.4.4.2 报告期内与基金管理人运用固有资金投资债券的情况
单位:人民币元

7.4.4.4.4.3 与关联方银行间同业市场的债券(含回购)交易
单位:人民币元

7.4.4.4.4.4 与关联方债券买卖的情况
7.4.4.4.4.4.1 报告期内与基金管理人运用固有资金投资债券的情况
单位:人民币元

7.4.4.4.4.4.2 报告期内与基金管理人运用固有资金投资债券的情况
单位:人民币元

7.4.4.4.4.4.3 与关联方银行间同业市场的债券(含回购)交易
单位:人民币元

7.4.4.4.4.4.4 与关联方债券买卖的情况
7.4.4.4.4.4.4.1 报告期内与基金管理人运用固有资金投资债券的情况
单位:人民币元

7.4.4.4.4.4.4.2 报告期内与基金管理人运用固有资金投资债券的情况
单位:人民币元

7.4.4.4.4.4.4.3 与关联方银行间同业市场的债券(含回购)交易
单位:人民币元

7.4.4.4.4.4.4.4 与关联方债券买卖的情况
7.4.4.4.4.4.4.4.1 报告期内与基金管理人运用固有资金投资债券的情况
单位:人民币元

7.4.4.4.4.4.4.4.2 报告期内与基金管理人运用固有资金投资债券的情况
单位:人民币元

7.4.4.4.4.4.4.4.3 与关联方银行间同业市场的债券(含回购)交易
单位:人民币元

7.4.4.4.4.4.4.4.4 与关联方债券买卖的情况
7.4.4.4.4.4.4.4.4.1 报告期内与基金管理人运用固有资金投资债券的情况
单位:人民币元

7.4.4.4.4.4.4.4.4.2 报告期内与基金管理人运用固有资金投资债券的情况
单位:人民币元

8.6 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
金额单位:人民币元

8.7 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
金额单位:人民币元

8.8 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
金额单位:人民币元

8.9 期末投资组合报告
8.10 投资组合报告

8.11 投资组合报告
8.12 投资组合报告

8.13 投资组合报告
8.14 投资组合报告

8.15 投资组合报告
8.16 投资组合报告

8.17 投资组合报告
8.18 投资组合报告

8.19 投资组合报告
8.20 投资组合报告

8.21 投资组合报告
8.22 投资组合报告

8.23 投资组合报告
8.24 投资组合报告

8.25 投资组合报告
8.26 投资组合报告

8.27 投资组合报告
8.28 投资组合报告

8.29 投资组合报告
8.30 投资组合报告

8.31 投资组合报告
8.32 投资组合报告

8.33 投资组合报告
8.34 投资组合报告

8.35 投资组合报告
8.36 投资组合报告

8.37 投资组合报告
8.38 投资组合报告

8.39 投资组合报告
8.40 投资组合报告

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
基金合同生效日期:2005年8月29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
基金合同生效日期:2005年8月29日