



信息披露

2013年10月24日 星期四
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B203

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告中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。
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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预示其未来表现,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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实中证500ETF(场内简称:500ETF)
基金代码	159022
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月6日
报告期末基金份额总额	107,531,868.00份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的构成成份及其权重构建跟踪组合,并随着标的指数成份及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证500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水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,跟踪跟踪标的指数的表现,具有与标的指数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	中国建设银行股份有限公司

§ 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(2013年7月1日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益	5,593,427.63
2.本期利润	90,265,705.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.6997
4.期末基金份额净值	418,516.87386
5.期末基金净值	3,8920

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率水平要低于所列数字。

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③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	19.58%	1.57%	16.68%	1.38%	-0.10%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

嘉实中证500ETF基金自成立以来的基金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

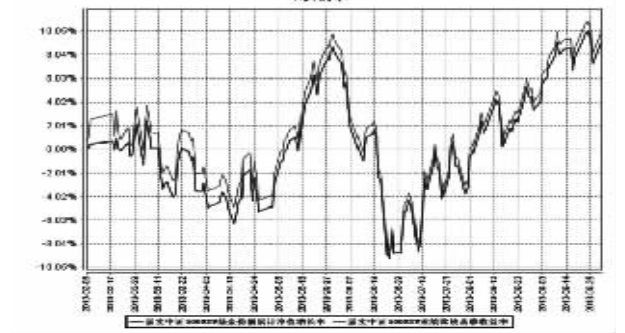


图:嘉实中证500ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金基金合同生效日2013年2月6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“第十四部分(二)投资组合限制和七)投资限制”的有关约定。

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
杨宇	本基金、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接基金、嘉实中证500ETF联接基金(LOF)、嘉实中证500ETF联接基金(LOF)的基金经理	2013年2月6日	15年	曾先后担任平安保险投资管理有限公司基金交易部交易员、嘉实基金管理有限公司交易员、嘉实基金管理有限公司基金经理,2004年7月加入嘉实基金管理有限公司,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 管理人对于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守了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证500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有关规定,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,本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,在严格执行投资决策流程和独立决策,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,通过完善交易流程内交易交易的公平交易执行机制,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0.01%,年化组合偏离度为0.20%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不得超过0.2%的限制。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

截至报告期末,本基金份额净值为3.8920元;本报告期基金份额净值增长率为19.58%,业绩比较基准收益率为16.68%。

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
本基金作为一只投资于中证500指数的被动投资型产品,我们将继续秉承指数化被动投资策略,积极应对全球宏观环境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,给投资者提供一标准化的中证500指数的投资工具。

§ 5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	416,019,778.52	99.27
2	固定收益投资	416,019,778.52	99.27
3	其中:债券	263,436.10	0.06
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	2,576,803.57	0.61
9	其他资产	218,648.70	0.05
10	合计	419,078,866.89	100.00

注:按投资标的公允价值包含可替代替代的估值增值。

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10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告中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。
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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预示其未来表现,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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实中证中期企业债指数(LOF)(场内简称:中债企)
基金代码	160720
基金运作方式	上市契约开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年2月5日
报告期末基金份额总额	889,322,391.38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量化的风险管理手段,力争本基金的净值增长率与业绩比较基准的日均跟踪误差的绝对值不超过0.3%,跟踪偏离度不超过0.4%。
投资策略	本基金为被动式指数基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数,投资于标的指数中权重较大的成份证券,或选择部分权重较大的成份证券构建投资组合,并随着标的指数成份及其权重的变动进行相应调整,并随着标的指数成份及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证中期企业债指数收益率+0.95%银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。本基金为指数型基金,跟踪跟踪标的指数的表现,具有与标的指数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	中国银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	嘉实中证中期企业债指数(LOF)
下属两级基金的交易代码	160720
报告期末下属两级基金的份额总额	764,067,214.57份

§ 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(2013年7月1日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益	3,996,454.64
2.本期利润	-9,286,953.90
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0101
4.期末基金份额净值	765,734.0552
5.期末基金净值	1,0022

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率水平要低于所列数字。

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③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.01%	0.10%	-0.33%	0.09%	-0.48%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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1:嘉实中证中期企业债指数(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

注:本基金基金合同生效日2013年2月5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“十五(二)投资组合限制和七)投资限制”的有关约定。

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
杨宇	本基金、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接基金、嘉实中证500ETF联接基金(LOF)、嘉实中证500ETF联接基金(LOF)的基金经理	2013年2月5日	15年	曾先后担任平安保险投资管理有限公司基金交易部交易员、嘉实基金管理有限公司交易员、嘉实基金管理有限公司基金经理,2004年7月加入嘉实基金管理有限公司,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。

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	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	6,831,155.60	1.63
B	采矿业	7,224,367.22	1.73
C	制造业	239,052,878.39	57.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,961,889.72	4.05
E	建筑业	10,758,298.97	2.57
F	批发和零售业	25,856,150.60	6.18
G	交通运输、仓储和邮政业	13,270,453.32	3.17
H	住宿和餐饮业	498,806.00	0.12
I	信息技术、软件和信息技术服务业	70,326,964.86	7.34
J	金融业	4,443,770.01	1.06
K	房地产业	37,336,253.02	8.93
L	租赁和商务服务业	4,767,358.32	1.14
M	科学研究和技术服务业	1,757,325.57	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	2,041,991.50	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	12,940,403.20	3.09
S	综合	1,533,911.22	0.37
合计		416,021,837.52	99.40

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

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	002230	科大讯飞	75,798	3,469,500.76	0.86
2	000593	海康控股	164,830	3,346,049.00	0.80
3	000917	广电传媒	162,700	3,042,490.00	0.73
4	600880	博瑞传播	101,486	2,963,391.20	0.71
5	000400	许继电气	89,660	2,889,741.80	0.69
6	600793	华闻传媒	219,125	2,881,493.75	0.69
7	000661	长春高新	24,237	2,673,583.47	0.64
8	600887	通达股份	148,910	2,625,283.30	0.63
9	600780	南方航空	112,663	2,429,014.28	0.58
10	600643	爱建集团	176,475	2,278,292.25	0.54

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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债	263,636.10	0.06
9	其他	-	-
合计		263,636.10	0.06

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110024	国债02-13	2,590	263,636.10	0.06

注:报告期末本基金仅持有上述1只债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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序的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

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,本基金投资的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,没有超出基金合同规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(元)
1	存出保证金	192,531.90
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	630.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	25,466.46
8	其他	-
合计		218,648.70

注:报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

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,本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.5.2 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

报告期末基金份额总额	156,131,868.00
报告期期间基金总申购额	3,600,000.00
减:报告期期间基金总赎回额	52,200,000.00
报告期期间基金总申购额	3,600,000.00
减:报告期期间基金总赎回额	52,200,000.00
报告期末基金份额总额	107,531,868.00

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金管理基金情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金基金的情况。

§ 8 备查文件目录

- (一)中国证监会核准嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;
- (二)《嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
- (三)《嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;
- (四)《嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
- (五)基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (六)报告期内嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金公告的原稿。

8.2 备查地点

(1)北京市建国门内大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司
(2)北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行股份有限公司

8.3 查阅方式

(1)书面查阅: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)网站查阅:基金管理人网站: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
2013年10月24日

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2013 第三季度 报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告中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。
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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预示其未来表现,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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实中证500ETF联接基金
基金代码	000008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月22日
报告期末基金份额总额	61,924,290.44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0.35%,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,本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的80.35%。在控制跟踪误差的前提下,本基金还可投资于标的指数成份股、备选成份股等。本基金投资于股票资产的比例不低于4%,如标的指数的成份股因其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围,基金管理人可相应调整投资组合以使基金资产净值更接近于目标ETF。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为嘉实中证500ETF的联接基金,主要通过投资于嘉实中证500ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪,因此,本基金的风险收益特征与中证500指数及嘉实中证500ETF的表现密切相关,本基金长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、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	中国建设银行股份有限公司

2.1.1 基金基本情况

基金简称	嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	159022
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月6日
基金上市证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013年3月15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	中国建设银行股份有限公司

2.1.2 基金产品说明

投资目标:本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
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投资组合,并随着标的指数成份及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准:中证500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水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金、货币市场基金。本基金为指数型基金,跟踪跟踪标的指数的表现,具有与标的指数及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§ 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(2013年7月1日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益	2,904,865.34
2.本期利润	14,968,107.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.1736
4.期末基金份额净值	68,824,327.83
5.期末基金净值	1,114

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率水平要低于所列数字。

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</
----	----------