

嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2010 年年度报告

2010 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2011 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 审计报告	12
§ 7 年度财务报表	13
7.1 资产负债表	13
7.2 利润表	14
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
7.4 报表附注	16
§ 8 投资组合报告	36
8.1 期末基金资产组合情况	36

8.2 期末按行业分类的股票投资组合	36
8.3 期末投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	48
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	48
8.9 投资组合报告附注	48
§ 9 基金份额持有人信息	49
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
9.2 期末上市基金场内前十名持有人	49
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	50
§ 10 开放式基金份额变动	50
§ 11 重大事件揭示	50
11.1 基金份额持有人大会决议	50
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
11.4 基金投资策略的改变	51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
11.8 其他重大事件	53
§ 12 备查文件目录	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) (深交所上市简称: 嘉实 300)
基金简称	嘉实沪深 300 指数 (LOF)
基金主代码	160706
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	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
报告期末基金份额总额	41,697,096,555.11 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2005 年 10 月 17 日

2.2 基金产品说明

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, 力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%, 以实现沪深 300 指数的有效跟踪, 谋求通过中国证券市场来分享中国经济持续、稳定、快速发展的成果。
投资策略	本基金为被动式指数基金, 原则上采用指数复制法, 按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数增长率 \times 95% + 银行同业存款收益率 \times 5%
风险收益特征	本基金运用指数复制法进行被动式指数化投资, 力争控制本基金净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	唐州徽
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66594855
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010) 65182266	(010) 66594942
注册地址		上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100005	100818
法定代表人		王忠民	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	-998,571,535.73	-2,811,904,695.26	-6,304,201,197.93
本期利润	-4,164,505,317.11	16,906,362,216.91	-27,006,729,827.78
加权平均基金份额本期利润	-0.0969	0.4135	-0.8134
本期加权平均净值利润率	-12.23%	54.24%	-104.59%
本期基金份额净值增长率	-11.45%	91.97%	-64.36%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配利润	-10,648,669,253.14	-10,058,694,469.56	-20,365,820,155.89
期末可供分配基金份额利润	-0.2554	-0.2318	-0.5273
期末基金资产净值	33,526,471,620.62	39,393,479,817.24	18,256,456,339.14
期末基金份额净值	0.8040	0.908	0.473
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
基金份额累计净值增长率	201.43%	240.42%	77.33%

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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	6.01%	1.68%	6.28%	1.68%	-0.27%	0.00%

过去六个月	20.78%	1.47%	20.95%	1.47%	-0.17%	0.00%
过去一年	-11.45%	1.50%	-11.77%	1.50%	0.32%	0.00%
过去三年	-39.41%	2.22%	-39.16%	2.21%	-0.25%	0.01%
过去五年	207.27%	2.08%	223.90%	2.07%	-16.63%	0.01%
自基金合同生效起至今	201.43%	2.02%	222.42%	2.01%	-20.99%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为沪深 300 指数增长率 \times 95% + 银行同业存款收益率 \times 5%。本基金原则上将不低于 90% 的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股，选用以上业绩衡量基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

Benchmark $_0$ = 1000

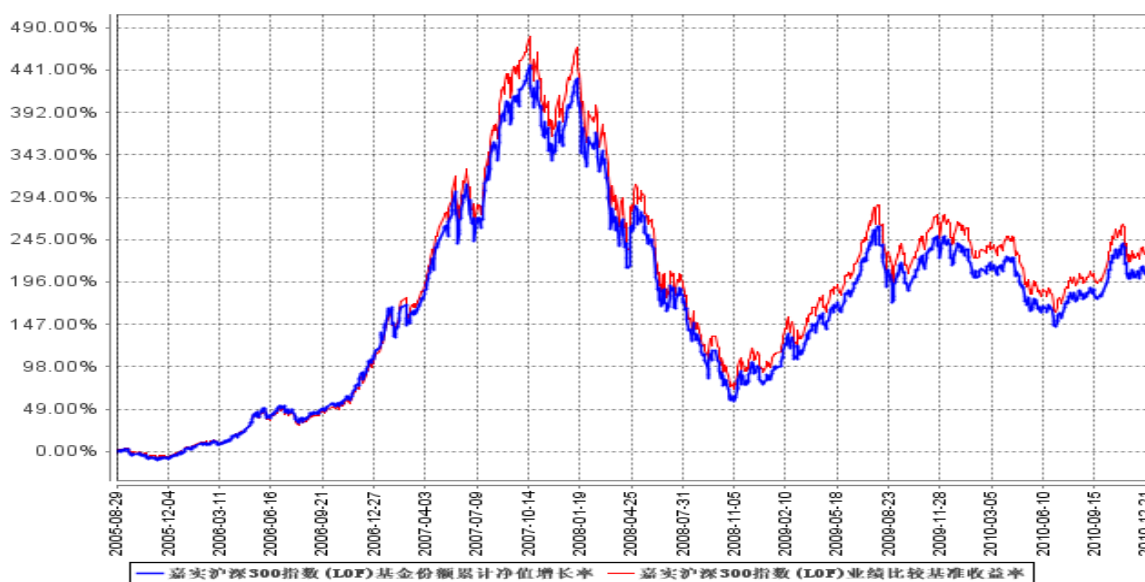
Return $_t$ = 95% \times (沪深 300 指数 $_t$ / (沪深 300 指数 $_{t-1}$) - 1) + 5% \times 同业存款日收益率

Benchmark $_t$ = (1 + Return $_t$) \times Benchmark $_{t-1}$

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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

嘉实沪深300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



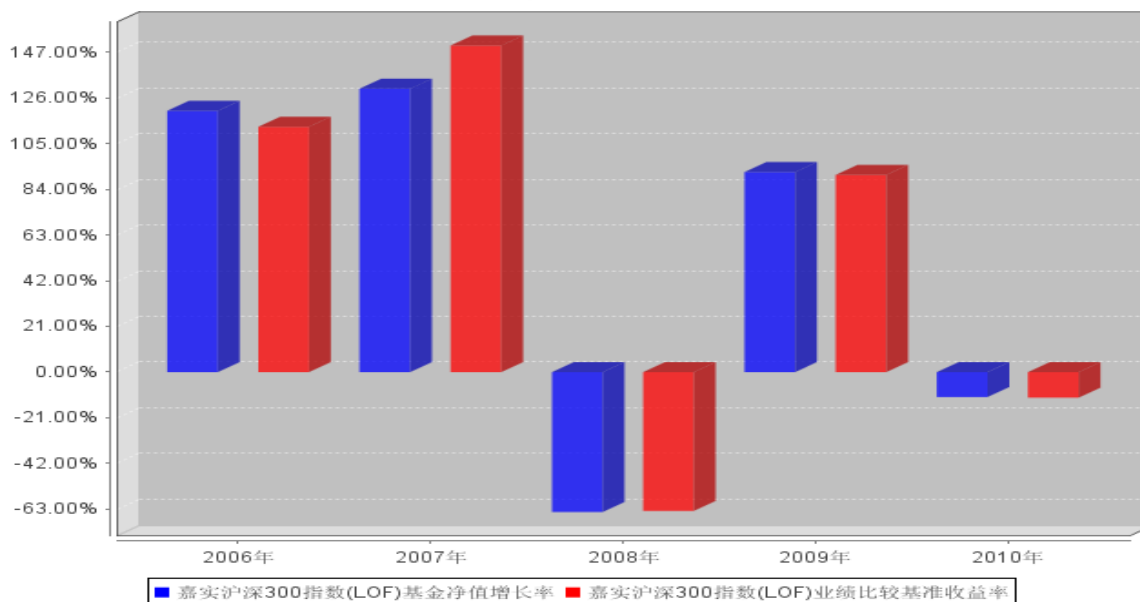
注：按基金合同约定，本基金自基金合同生效起 3 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同第十七条（二）投资范围和（七）投资禁止行为与限制）的规定：

（1）基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；（2）原则上将不低于 90% 的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于 15%，现金或者到期日在一年

以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。(3)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实沪深300指数(LOF)过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地在上海,公司总部设在北京,在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。

截至2010年12月31日,基金管理人共管理2只封闭式基金、21只开放式基金,具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300指数(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实价值优势股票、

嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列证券投资基金, 同时, 管理多个全国社保基金、企业年金基金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

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	本基金基金经理、产品结构产品投资部总监	2005 年 8 月 29 日	-	12	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) 任职日期指本基金合同生效之日; (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合规守信情况的说明

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、《嘉实沪深 300 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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, 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基金和组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与其他投资组合的投资风格不同, 未与其他投资组合进行业绩比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金不存在异常交易行为。

4.4 管理人对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 0.04%,年度化拟合偏离度为 0.63%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.3%的限制。本基金跟踪误差来源主要是长期停牌股票估值方法的变更,由于本基金对长期停牌股票采用指数收益法进行估值,而沪深 300 指数仍然按照该股票停牌前的收盘价格计算,指数收益法所计算的股票价格和股票停牌前的收盘价格之间的差异,是跟踪误差的主要来源。

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 0.8040 元;本报告期基金份额净值增长率为-11.45%,业绩比较基准收益率为-11.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2011 年,随着中国经济转型的逐步推进,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 A 股市场的长期发展前景,并对未来 A 股市场的长期表现充满信心。随着以沪深 300 指数作为标的的股指期货的成交活跃,沪深 300 指数将进一步强化在中国的市场地位。本基金作为一只投资于沪深 300 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沪深 300 指数的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,基金管理人重点开展了合规管理、内部审计、法律事务、制度建设、海外业务、信息披露等方面监察稽核工作,采取的主要措施如下:

(1) 内控前置:在新产品设计、新业务拓展、基金营销、投资管理、海外业务、信息披露等方面,全面实现内控前置,从组织保证和制度安排确保内控的独立性和权威性,在参与公司新项目活动、事前合规审核、制度建设等方面紧跟公司业务发展战略,为公司决策、业务部门提供充足的法律支持以及合规、操作风险防范措施。

(2) 差错管理:差错管理目标是无重大差错和违规,公司全面开展了风险导向型内审、差错统计分析和风险控制委员会等工作。

(3) “三条底线”防范:公司管理层多次要求公司和全体员工,都不能触犯“老鼠仓”、非公平交易和各种形式的利益输送这三条底线,同时采取有效防范措施。公司管理的不同投资组合能够得到公平对待,未发现违法违规行为。

(4) 海外业务合规与支持,启动 GIPS 认证和 SAS70 审计,实施严格内控,强化公司的国际竞争力,增强客户信心,为年金、特定资产管理业务、海外等业务拓展创造了良好条件。

(5)信息披露和投资者关系管理工作：完成 23 只基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《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和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额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。月末、年中 and 年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、运营、风险管理、法律稽核等部门负责人以及基金经理组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 报告期内本基金未实施利润分配；

(2) 根据本报告 3.1.1 “本期利润”为-4,164,505,317.11 元、3.1.2 “期末可供分配利润”为-10,648,669,253.14 元，以及本基金基金合同（二十二（三）收益分配原则）“3、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配”，因此本基金未实施 2010 年度分配利润，符合基金合同的约定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对嘉实沪深 300 指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议

的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2011)第 20639 号

嘉实沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的嘉实沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“嘉实沪深 300 指数基金”)的财务报表,包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是嘉实沪深 300 指数基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:

(1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;

(2) 选择和运用恰当的会计政策;

(3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行

风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了嘉实沪深 300 指数基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天

会计师事务所有限公司

中国上海市

注册会计师

汪 棣

陈 宇

2011 年 3 月 14 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	659,006,956.47	949,646,501.86
结算备付金		1,181,562.90	4,408,182.66
存出保证金		2,013,453.69	4,103,652.91
交易性金融资产	7.4.7.2	32,848,990,671.88	38,447,246,176.41
其中：股票投资		31,741,080,671.88	37,350,656,176.41
基金投资		-	-
债券投资		1,107,910,000.00	1,096,590,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,321,387.74	92,574,760.00

应收利息	7.4.7.5	26,893,308.61	2,106,502.48
应收股利		-	-
应收申购款		30,356,504.20	45,374,913.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		33,571,763,845.49	39,545,460,689.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		18,778,915.39	124,913,305.06
应付管理人报酬		14,560,553.95	16,380,787.90
应付托管费		2,912,110.81	3,276,157.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	7,827,082.02	5,839,131.87
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,213,562.70	1,571,490.29
负债合计		45,292,224.87	151,980,872.70
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	41,697,096,555.11	43,393,057,963.84
未分配利润	7.4.7.10	-8,170,624,934.49	-3,999,578,146.60
所有者权益合计		33,526,471,620.62	39,393,479,817.24
负债和所有者权益总计		33,571,763,845.49	39,545,460,689.94

注: 报告截止日 2010 年 12 月 31 日, 基金份额净值 0.8040 元, 基金份额总额 41,697,096,555.11 份。

7.2 利润表

会计主体: 嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
一、收入		-3,929,525,413.54	17,137,203,176.01

1. 利息收入		33,587,243.08	30,321,526.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,368,493.02	6,854,379.79
债券利息收入		27,218,750.06	23,467,146.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-813,052,970.79	-2,646,839,477.60
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,143,592,396.66	-2,898,003,591.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	322,780.00	-11,487,412.24
资产支持证券投资	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	1,047,940.38
股利收益	7.4.7.16	330,216,645.87	261,603,586.18
3. 公允价值变动收益	7.4.7.17	-3,165,933,781.38	19,718,266,912.17
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.18	15,874,095.55	35,454,215.30
二、费用		234,979,903.57	230,840,959.10
1. 管理人报酬		170,087,516.16	154,198,527.23
2. 托管费		34,017,503.24	30,839,705.42
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	30,039,133.89	44,766,598.56
5. 利息支出		258,637.14	459,323.17
其中：卖出回购金融资产支出		258,637.14	459,323.17
6. 其他费用	7.4.7.20	577,113.14	576,804.72
三、利润总额		-4,164,505,317.11	16,906,362,216.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-4,164,505,317.11	16,906,362,216.91

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	43,393,057,963.84	-3,999,578,146.60	39,393,479,817.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,164,505,317.11	-4,164,505,317.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,695,961,408.73	-6,541,470.78	-1,702,502,879.51

其中：1. 基金申购款	17,814,794,943.38	-3,526,183,007.17	14,288,611,936.21
2. 基金赎回款	-19,510,756,352.11	3,519,641,536.39	-15,991,114,815.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	41,697,096,555.11	-8,170,624,934.49	33,526,471,620.62
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	38,622,276,495.03	-20,365,820,155.89	18,256,456,339.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,906,362,216.91	16,906,362,216.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	4,770,781,468.81	-540,120,207.62	4,230,661,261.19
其中：1. 基金申购款	45,304,373,957.61	-10,693,597,226.14	34,610,776,731.47
2. 基金赎回款	-40,533,592,488.80	10,153,477,018.52	-30,380,115,470.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	43,393,057,963.84	-3,999,578,146.60	39,393,479,817.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>赵学军</u>	<u>李松林</u>	<u>王红</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]第 103 号《关于同意嘉实沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 866,926,792.65 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第 130 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实沪深 300 指数证

券投资基金基金合同》于 2005 年 8 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 867,126,900.07 份基金份额，其中认购资金利息折合 200,107.42 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2005]第 93 号文审核同意，本基金 344,534,887.00 份基金份额于 2005 年 10 月 17 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股，一级市场初次发行或增发的新股，以及不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具，待指数衍生金融产品推出以后，本基金可以运用衍生金融产品进行风险管理。本基金原则上将不低于 90%的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数增长率 X 95% + 银行同业存款收益率 X 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但

最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资,场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(a)对于特殊事项停牌股票,根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值,通过停牌股票所

处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金采用的行业指数为中证协(SAC)基金行业股票估值指数。

(b)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(c)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

报告期内本基金无涉及会计政策变更事项。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

报告期内本基金无涉及会计估计变更事项。

7.4.5.3 差错更正的说明

报告期内本基金无涉及重大会计差错事项。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
活期存款	659,006,956.47	949,646,501.86
定期存款	-	-
其中:存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	659,006,956.47	949,646,501.86

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2010年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	33,502,242,685.22	31,741,080,671.88	-1,761,162,013.34	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	1,117,197,210.00	1,107,910,000.00	-9,287,210.00
	合计	1,117,197,210.00	1,107,910,000.00	-9,287,210.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	34,619,439,895.22	32,848,990,671.88	-1,770,449,223.34	
项目	上年度末 2009年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	35,955,061,618.37	37,350,656,176.41	1,395,594,558.04	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	1,096,700,000.00	1,096,590,000.00	-110,000.00
	合计	1,096,700,000.00	1,096,590,000.00	-110,000.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	37,051,761,618.37	38,447,246,176.41	1,395,484,558.04	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

报告期末 (2010 年 12 月 31 日) 及上年度末 (2009 年 12 月 31 日), 本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

报告期末 (2010 年 12 月 31 日) 及上年度末 (2009 年 12 月 31 日), 本基金各项买入返售金融资产余额均为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

报告期末 (2010 年 12 月 31 日) 及上年度末 (2009 年 12 月 31 日), 本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	144,710.77	163,090.67
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	413.50	1,542.90
应收债券利息	26,747,852.06	1,935,262.38
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	308.98	6,583.23
其他	23.30	23.30
合计	26,893,308.61	2,106,502.48

7.4.7.6 其他资产

报告期末 (2010 年 12 月 31 日) 及上年度末 (2009 年 12 月 31 日), 本基金未持有其他资产 (其他应收款、待摊费用)。

7.4.7.7 应付交易费用

单位: 人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	7,827,082.02	5,832,655.36
银行间市场应付交易费用	-	6,476.51
合计	7,827,082.02	5,839,131.87

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	1,000,000.00	1,000,000.00
应付赎回费	43,562.70	401,490.29
预提费用	170,000.00	170,000.00
合计	1,213,562.70	1,571,490.29

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	43,393,057,963.84	43,393,057,963.84
本期申购	17,814,794,943.38	17,814,794,943.38
本期赎回	-19,510,756,352.11	-19,510,756,352.11
本期末	41,697,096,555.11	41,697,096,555.11

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-10,058,694,469.56	6,059,116,322.96	-3,999,578,146.60
本期利润	-998,571,535.73	-3,165,933,781.38	-4,164,505,317.11
本期基金份额交易产生的变动数	408,596,752.15	-415,138,222.93	-6,541,470.78
其中：基金申购款	-4,262,752,820.64	736,569,813.47	-3,526,183,007.17
基金赎回款	4,671,349,572.79	-1,151,708,036.40	3,519,641,536.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,648,669,253.14	2,478,044,318.65	-8,170,624,934.49

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	6,144,311.19	6,271,741.44
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	86,286.05	173,876.68
其他	137,895.78	408,761.67
合计	6,368,493.02	6,854,379.79

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
卖出股票成交总额	10,371,088,586.88	13,570,518,685.25
减：卖出股票成本总额	11,514,680,983.54	16,468,522,277.17
买卖股票差价收入	-1,143,592,396.66	-2,898,003,591.92

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
卖出债券、债转股及债券到期兑付成交总额	2,830,883,495.38	2,749,585,078.98
减：卖出债券、债转股及债券到期兑付成本总额	2,814,391,100.00	2,694,399,452.24
减：应收利息总额	16,169,615.38	66,673,038.98
债券投资收益	322,780.00	-11,487,412.24

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
卖出权证成交总额	-	35,406,179.33
减：卖出权证成本总额	-	34,358,238.95
买卖权证差价收入	-	1,047,940.38

注1：本报告期本基金无买卖权证差价收入。

注2：2009年买卖权证差价收入为阿胶EJC1(031007)行权产生。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
股票投资产生的股利收益	330,216,645.87	261,603,586.18
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	330,216,645.87	261,603,586.18

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
1. 交易性金融资产	-3,165,933,781.38	19,718,266,912.17
——股票投资	-3,156,756,571.38	19,720,254,679.93
——债券投资	-9,177,210.00	-1,987,767.76
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-3,165,933,781.38	19,718,266,912.17

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
基金赎回费收入	15,775,782.66	35,401,675.60
基金转出费收入	45,981.19	-
印花税手续费返还	52,331.70	-
其他	-	52,539.70
合计	15,874,095.55	35,454,215.30

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
交易所市场交易费用	30,027,208.89	44,752,198.56
银行间市场交易费用	11,925.00	14,400.00
合计	30,039,133.89	44,766,598.56

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
审计费用	170,000.00	170,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行划款手续费	29,113.14	28,504.72
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	-	300.00
合计	577,113.14	576,804.72

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

报告期内，本基金不存在或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金不存在资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
国都证券有限责任公司	与基金管理人同受重大影响的公司、基金代销机构

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	170,087,516.16	154,198,527.23
其中：支付给销售机构的客户维护费	33,603,343.03	29,380,283.76

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	34,017,503.24	30,839,705.42

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率

计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为: 日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位: 人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	1,077,019,476.44	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	398,680,000.00	199,909,169.17	-	-	1,120,336,000.00	198,196.50

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位: 份

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
	基金合同生效日(2005年8月29日)持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	20,000,800.00	20,000,800.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	20,000,800.00	20,000,800.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.05%	0.05%

注: 2005年本基金发售期间, 基金管理人通过代销机构认购本基金基金份额20,000,000.00份, 认购费1,000.00元, 其认购资金利息结转的基金份额800份基金份额。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末(2010年12月31日)及上年度末(2009年12月31日), 其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2010年1月1日至2010年12月31日		2009年1月1日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	659,006,956.47	6,144,311.19	949,646,501.86	6,271,741.44

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未参与认购关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002537	海立美达	2010年12月31日	2011年1月10日	未上市	40.00	40.00	1,000	40,000.00	40,000.00	-
601118	海南橡胶	2010年12月30日	2011年1月7日	未上市	5.99	5.99	5,000	29,950.00	29,950.00	-
300156	天立环保	2010年12月29日	2011年1月7日	未上市	58.00	58.00	500	29,000.00	29,000.00	-
300157	恒泰艾普	2010年12月29日	2011年1月7日	未上市	57.00	57.00	500	28,500.00	28,500.00	-
002534	杭锅股份	2010年12月31日	2011年1月10日	未上市	26.00	26.00	1,000	26,000.00	26,000.00	-
300155	安居宝	2010年12月29日	2011年1月7日	未上市	49.00	49.00	500	24,500.00	24,500.00	-
002535	林州重机	2010年12月31日	2011年1月11日	未上市	25.00	25.00	500	12,500.00	12,500.00	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

报告期末（2010年12月31日），本基金未持有流通受限的债券。

7.4.12.1.3 受限证券类别：其他

报告期末（2010年12月31日），本基金未持有流通受限的其他证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600518	康美药	2010.12.	配股申购期	19.71	2011.1.6	17.29	6,925,258	63,280,763.68	136,496,835.18	-

	业	28	间停牌							
600664	哈药股份	2010.12.29	重要事项未公告	22.57	2011.2.16	24.83	4,310,956	59,750,936.05	97,298,276.92	-
000652	泰达股份	2010.11.22	重要事项未公告	7.78	未知	未知	6,347,006	74,696,989.74	49,379,706.68	-
000059	辽通化工	2010.12.2	筹划重大资产重组	11.59	未知	未知	3,657,438	34,892,179.34	42,389,706.42	-
000959	首钢股份	2010.10.29	筹划重大资产重组	4.42	未知	未知	7,707,708	43,285,392.06	34,068,069.36	-
600816	安信信托	2010.6.2	重要事项未公告	13.60	未知	未知	2,016,505	35,878,441.58	27,424,468.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

报告期末（2010年12月31日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

报告期末（2010年12月31日），本基金无交易所债券正回购余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为进行被动指数化投资的股票型证券投资基金，属于中等风险品种，获得证券市场平均收益率。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于0.3%，以实现沪深300指数的有效跟踪，谋求通过中国证券市场来分享中国经济持续、稳定、快速发展的成果。

本基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、副总经理、督察长、总经理助理以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体

负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2009 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险, 本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求, 保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款, 约定在非常情况下赎回申请的处理方式, 控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险, 有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险, 本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求, 对流动性指标进行持续的监测和分析, 包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外, 其余均能及时变现。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险, 其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控, 并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息, 因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2010年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	659,006,956.47	-	-	-	659,006,956.47
结算备付金	1,181,562.90	-	-	-	1,181,562.90
存出保证金	66,700.00	-	-	1,946,753.69	2,013,453.69
交易性金融资产	1,107,910,000.00	-	-	31,741,080,671.88	32,848,990,671.88
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,321,387.74	3,321,387.74
应收利息	-	-	-	26,893,308.61	26,893,308.61
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	2,260,520.25	-	-	28,095,983.95	30,356,504.20
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,770,425,739.62	-	-	31,801,338,105.87	33,571,763,845.49
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	18,778,915.39	18,778,915.39
应付管理人报酬	-	-	-	14,560,553.95	14,560,553.95
应付托管费	-	-	-	2,912,110.81	2,912,110.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	7,827,082.02	7,827,082.02
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,213,562.70	1,213,562.70
负债总计	-	-	-	45,292,224.87	45,292,224.87
利率敏感度缺口	1,770,425,739.62	-	-	31,756,045,881.00	33,526,471,620.62
上年度末 2009年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	949,646,501.86	-	-	-	949,646,501.86
结算备付金	4,408,182.66	-	-	-	4,408,182.66
存出保证金	66,700.00	-	-	4,036,952.91	4,103,652.91
交易性金融资产	1,096,590,000.00	-	-	37,350,656,176.41	38,447,246,176.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	92,574,760.00	92,574,760.00
应收利息	-	-	-	2,106,502.48	2,106,502.48
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	2,171,069.63	-	-	43,203,843.99	45,374,913.62
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,052,882,454.15	-	-	37,492,578,235.79	39,545,460,689.94

负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	124,913,305.06	124,913,305.06
应付管理人报酬	-	-	-	16,380,787.90	16,380,787.90
应付托管费	-	-	-	3,276,157.58	3,276,157.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,839,131.87	5,839,131.87
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,571,490.29	1,571,490.29
负债总计	-	-	-	151,980,872.70	151,980,872.70
利率敏感度缺口	2,052,882,454.15	-	-	37,340,597,363.09	39,393,479,817.24

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.30% (2009 年 12 月 31 日：2.78%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2009 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为以完全复制为目标的被动型指数基金，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

本基金原则上将不低于 90% 的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股，其中

备选成份股投资比例不高于 15%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	31,741,080,671.88	94.67	37,350,656,176.41	94.81
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	31,741,080,671.88	94.67	37,350,656,176.41	94.81

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)	
		本期末 (2010 年 12 月 31 日)	上年度末 (2009 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 166,342	增加约 196,731
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 166,342	减少约 196,731	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项:

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输

入值)。

于 2010 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 31,354,023,609.32 元, 属于第二层级的余额为 1,494,967,062.56 元, 无属于第三层级的余额 (2009 年 12 月 31 日: 第一层级 36,550,827,494.48 元, 第二层级 1,896,418,681.93 元, 无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票, 本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级, 并于复牌后从第二层级转回第一层级 (2009 年度: 同)。对于持有的非公开发行股票, 本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层级列入第二层级, 并于限售期满后从第二层级转入第一层级, 本基金于本年度内未发生持有的非公开发行股票限售期满的情况 (2009 年度: 非公开发行股票的公允价值所属层级于限售期满后从第二层级转入第一层级)。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	31,741,080,671.88	94.55
	其中: 股票	31,741,080,671.88	94.55
2	固定收益投资	1,107,910,000.00	3.30
	其中: 债券	1,107,910,000.00	3.30
	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	660,188,519.37	1.97
6	其他各项资产	62,584,654.24	0.19
	合计	33,571,763,845.49	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位: 人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	106,341,902.31	0.32
B	采掘业	3,884,360,053.91	11.59

C	制造业	11,390,796,312.65	33.98
C0	食品、饮料	1,811,505,649.69	5.40
C1	纺织、服装、皮毛	120,696,554.44	0.36
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	814,435,083.76	2.43
C5	电子	192,863,011.60	0.58
C6	金属、非金属	2,710,708,009.23	8.09
C7	机械、设备、仪表	4,106,534,900.90	12.25
C8	医药、生物制品	1,527,724,817.43	4.56
C99	其他制造业	106,328,285.60	0.32
D	电力、煤气及水的生产和供应业	784,815,426.23	2.34
E	建筑业	928,291,682.52	2.77
F	交通运输、仓储业	1,433,269,549.51	4.28
G	信息技术业	1,103,868,588.26	3.29
H	批发和零售贸易	932,483,601.50	2.78
I	金融、保险业	8,431,044,443.83	25.15
J	房地产业	1,673,108,420.83	4.99
K	社会服务业	291,917,309.44	0.87
L	传播与文化产业	45,588,212.50	0.14
M	综合类	707,580,250.39	2.11
	合计	31,713,465,753.88	94.59

8.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	29,950.00	0.00
B	采掘业	28,500.00	0.00
C	制造业	132,000.00	0.00
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	24,500.00	0.00
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	107,500.00	0.00
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	27,424,468.00	0.08
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	27,614,918.00	0.08

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	19,206,230	1,078,621,876.80	3.22
2	600036	招商银行	70,887,868	908,073,589.08	2.71
3	601328	交通银行	119,317,922	653,862,212.56	1.95
4	600016	民生银行	129,479,872	649,988,957.44	1.94
5	600000	浦发银行	49,351,484	611,464,886.76	1.82
6	601166	兴业银行	24,045,550	578,295,477.50	1.72
7	601398	工商银行	118,825,432	503,819,831.68	1.50
8	600030	中信证券	39,908,511	502,448,153.49	1.50
9	601088	中国神华	18,906,500	467,179,615.00	1.39
10	000002	万科A	55,490,620	456,132,896.40	1.36
11	601601	中国太保	18,018,845	412,631,550.50	1.23
12	600519	贵州茅台	2,164,098	398,020,904.16	1.19
13	000858	五粮液	10,879,941	376,772,356.83	1.12
14	002024	苏宁电器	24,062,854	315,223,387.40	0.94
15	601169	北京银行	24,988,997	285,874,125.68	0.85
16	600837	海通证券	28,298,846	272,800,875.44	0.81
17	601006	大秦铁路	34,088,619	266,573,000.58	0.80
18	600050	中国联通	48,602,511	260,023,433.85	0.78
19	601939	建设银行	54,994,130	252,423,056.70	0.75
20	000001	深发展A	15,981,883	252,353,932.57	0.75
21	600031	三一重工	11,608,013	251,081,321.19	0.75
22	601899	紫金矿业	30,197,678	247,922,936.38	0.74
23	601857	中国石油	21,538,752	241,664,797.44	0.72
24	000983	西山煤电	9,031,907	241,061,597.83	0.72
25	601668	中国建筑	68,788,113	235,255,346.46	0.70

26	600585	海螺水泥	7,642,564	226,831,299.52	0.68
27	000063	中兴通讯	8,055,429	219,913,211.70	0.66
28	600089	特变电工	11,621,555	216,858,216.30	0.65
29	600547	山东黄金	4,078,773	214,992,124.83	0.64
30	600362	江西铜业	4,758,425	214,938,057.25	0.64
31	600900	长江电力	28,375,178	214,800,097.46	0.64
32	000651	格力电器	11,307,243	205,000,315.59	0.61
33	600048	保利地产	15,737,495	199,866,186.50	0.60
34	600111	包钢稀土	2,776,839	198,377,378.16	0.59
35	600348	国阳新能	6,893,216	197,697,434.88	0.59
36	000157	中联重科	13,874,240	196,181,753.60	0.59
37	600019	宝钢股份	30,115,604	192,438,709.56	0.57
38	600028	中国石化	23,869,494	192,388,121.64	0.57
39	000338	潍柴动力	3,615,114	189,323,520.18	0.56
40	600015	华夏银行	17,164,522	187,093,289.80	0.56
41	000527	美的电器	10,731,934	186,735,651.60	0.56
42	601628	中国人寿	8,598,573	183,149,604.90	0.55
43	601168	西部矿业	9,562,193	180,151,716.12	0.54
44	600256	广汇股份	4,259,661	178,607,585.73	0.53
45	600887	伊利股份	4,582,084	175,310,533.84	0.52
46	000792	盐湖钾肥	2,639,950	174,870,288.00	0.52
47	601766	中国南车	22,507,509	169,931,692.95	0.51
48	002202	金风科技	7,547,915	168,318,504.50	0.50
49	600489	中金黄金	4,078,841	164,540,445.94	0.49
50	000568	泸州老窖	3,996,180	163,443,762.00	0.49
51	600795	国电电力	52,948,202	162,021,498.12	0.48
52	600383	金地集团	25,632,214	158,407,082.52	0.47
53	601288	农业银行	59,103,102	158,396,313.36	0.47
54	601699	潞安环能	2,638,191	157,341,711.24	0.47
55	600739	辽宁成大	5,213,336	157,025,680.32	0.47
56	600104	上海汽车	10,596,207	155,552,318.76	0.46
57	000423	东阿阿胶	2,999,329	153,265,711.90	0.46
58	000895	双汇发展	1,736,907	151,110,909.00	0.45
59	000060	中金岭南	6,367,653	143,272,192.50	0.43
60	600068	葛洲坝	11,994,865	139,140,434.00	0.42
61	600415	小商品城	3,900,388	136,669,595.52	0.41
62	600518	康美药业	6,925,258	136,496,835.18	0.41
63	000425	徐工机械	2,364,888	135,271,593.60	0.40
64	601299	中国北车	19,031,404	134,932,654.36	0.40

65	601989	中国重工	11,437,804	134,851,709.16	0.40
66	601958	金钼股份	5,548,838	134,503,833.12	0.40
67	600875	东方电气	3,815,148	133,148,665.20	0.40
68	601111	中国国航	9,549,267	130,633,972.56	0.39
69	600406	国电南瑞	1,806,361	130,166,373.66	0.39
70	000630	铜陵有色	3,709,894	130,031,784.70	0.39
71	600690	青岛海尔	4,608,748	130,012,781.08	0.39
72	600276	恒瑞医药	2,148,068	127,938,930.08	0.38
73	601390	中国中铁	29,394,062	127,276,288.46	0.38
74	601919	中国远洋	13,131,098	123,432,321.20	0.37
75	601186	中国铁建	17,646,369	119,642,381.82	0.36
76	601009	南京银行	11,913,266	118,417,864.04	0.35
77	600029	南方航空	12,076,881	117,628,820.94	0.35
78	601788	光大证券	7,837,302	117,167,664.90	0.35
79	601898	中煤能源	10,492,507	113,948,626.02	0.34
80	000039	中集集团	4,943,301	113,646,489.99	0.34
81	601600	中国铝业	10,983,817	111,375,904.38	0.33
82	601666	平煤股份	5,205,817	109,790,680.53	0.33
83	601618	中国中冶	27,926,316	109,191,895.56	0.33
84	000069	华侨城A	8,906,630	108,215,554.50	0.32
85	600100	同方股份	3,987,974	105,721,190.74	0.32
86	000009	中国宝安	6,252,640	104,856,772.80	0.31
87	601607	上海医药	4,575,037	99,918,808.08	0.30
88	000878	云南铜业	3,601,917	99,052,717.50	0.30
89	600664	哈药股份	4,310,956	97,298,276.92	0.29
90	000528	柳 工	2,608,942	96,530,854.00	0.29
91	600188	兖州煤业	3,393,644	96,345,553.16	0.29
92	000538	云南白药	1,591,913	96,151,545.20	0.29
93	601727	上海电气	11,293,590	95,769,643.20	0.29
94	600123	兰花科创	1,964,687	92,497,463.96	0.28
95	600132	重庆啤酒	1,664,641	92,271,050.63	0.28
96	000402	金 融 街	13,881,810	91,758,764.10	0.27
97	600018	上港集团	24,065,341	91,688,949.21	0.27
98	600309	烟台万华	4,767,438	91,487,135.22	0.27
99	000933	神火股份	3,611,436	90,466,471.80	0.27
100	600583	海油工程	11,147,830	90,297,423.00	0.27
101	000623	吉林敖东	2,629,359	89,503,380.36	0.27
102	000012	南 玻A	4,519,897	89,267,965.75	0.27
103	601106	中国一重	14,991,258	89,048,072.52	0.27

104	600655	豫园商城	6,600,090	88,771,210.50	0.26
105	000709	河北钢铁	23,652,121	88,222,411.33	0.26
106	600166	福田汽车	3,628,075	88,089,661.00	0.26
107	601688	华泰证券	6,420,256	88,085,912.32	0.26
108	600115	东方航空	13,383,161	88,061,199.38	0.26
109	000825	太钢不锈	16,326,454	87,183,264.36	0.26
110	601808	中海油服	3,394,147	86,686,514.38	0.26
111	000768	西飞国际	7,101,303	86,209,818.42	0.26
112	000783	长江证券	7,467,820	84,386,366.00	0.25
113	600177	雅戈尔	7,658,289	83,628,515.88	0.25
114	600642	申能股份	10,842,814	82,730,670.82	0.25
115	600660	福耀玻璃	8,037,320	82,462,903.20	0.25
116	000401	冀东水泥	3,476,053	82,139,132.39	0.24
117	002142	宁波银行	6,612,450	81,994,380.00	0.24
118	000898	鞍钢股份	10,574,528	81,741,101.44	0.24
119	601001	大同煤业	3,837,771	80,631,568.71	0.24
120	600058	五矿发展	2,457,889	80,372,970.30	0.24
121	002007	华兰生物	1,651,576	79,919,762.64	0.24
122	600694	大商股份	1,683,787	79,794,665.93	0.24
123	000937	冀中能源	1,988,749	79,649,397.45	0.24
124	600999	招商证券	4,110,715	77,939,156.40	0.23
125	600832	东方明珠	9,132,644	77,718,800.44	0.23
126	600143	金发科技	4,803,158	77,378,875.38	0.23
127	600550	天威保变	3,347,734	77,299,178.06	0.23
128	000960	锡业股份	2,362,094	77,240,473.80	0.23
129	600150	中国船舶	1,139,492	77,200,583.00	0.23
130	600005	武钢股份	17,972,400	76,921,872.00	0.23
131	000800	一汽轿车	4,664,774	74,869,622.70	0.22
132	600549	厦门钨业	1,563,785	74,420,528.15	0.22
133	600497	驰宏锌锗	2,888,441	74,204,049.29	0.22
134	600812	华北制药	4,716,988	74,103,881.48	0.22
135	000725	京东方A	23,278,850	73,561,166.00	0.22
136	600196	复星医药	5,458,391	73,524,526.77	0.22
137	600271	航天信息	2,646,680	72,810,166.80	0.22
138	600881	亚泰集团	10,861,325	72,770,877.50	0.22
139	600997	开滦股份	3,538,715	71,234,332.95	0.21
140	600970	中材国际	1,740,898	70,871,957.58	0.21
141	000758	中色股份	2,200,265	69,396,358.10	0.21
142	601998	中信银行	13,195,482	69,276,280.50	0.21

143	600600	青岛啤酒	1,994,660	69,174,808.80	0.21
144	600352	浙江龙盛	5,892,317	69,116,878.41	0.21
145	600703	三安光电	1,505,072	69,022,601.92	0.21
146	600009	上海机场	5,523,020	68,430,217.80	0.20
147	000969	安泰科技	2,944,155	68,245,512.90	0.20
148	002155	辰州矿业	1,882,808	67,630,463.36	0.20
149	600320	振华重工	10,124,228	66,111,208.84	0.20
150	000729	燕京啤酒	3,468,866	65,873,765.34	0.20
151	002422	科伦药业	412,825	65,028,194.00	0.19
152	000839	中信国安	5,392,811	64,605,875.78	0.19
153	002399	海普瑞	458,716	63,821,157.08	0.19
154	000680	山推股份	3,481,517	63,328,794.23	0.19
155	000024	招商地产	3,949,523	62,994,891.85	0.19
156	600395	盘江股份	1,897,502	61,763,690.10	0.18
157	601866	中海集运	13,640,951	61,111,460.48	0.18
158	600221	海南航空	6,777,018	60,789,851.46	0.18
159	600741	华域汽车	5,923,128	60,475,136.88	0.18
160	600535	天士力	1,480,216	60,333,604.16	0.18
161	600582	天地科技	2,319,552	60,285,156.48	0.18
162	600811	东方集团	7,643,797	59,927,368.48	0.18
163	601179	中国西电	7,492,836	59,193,404.40	0.18
164	000778	新兴铸管	6,592,959	58,875,123.87	0.18
165	000422	湖北宜化	3,113,209	58,683,989.65	0.18
166	002128	露天煤业	2,281,529	58,224,620.08	0.17
167	600125	铁龙物流	4,029,721	58,108,576.82	0.17
168	002304	洋河股份	257,976	57,786,624.00	0.17
169	600631	百联股份	3,786,923	57,750,575.75	0.17
170	000999	华润三九	2,244,608	57,349,734.40	0.17
171	000562	宏源证券	3,350,508	56,087,503.92	0.17
172	600062	双鹤药业	1,966,342	56,021,083.58	0.17
173	601333	广深铁路	16,200,371	55,891,279.95	0.17
174	600010	包钢股份	14,729,018	55,822,978.22	0.17
175	601818	光大银行	14,044,196	55,615,016.16	0.17
176	600376	首开股份	3,295,388	55,527,287.80	0.17
177	000728	国元证券	4,503,624	55,214,430.24	0.16
178	600331	宏达股份	3,549,477	55,052,388.27	0.16
179	600588	用友软件	2,339,208	54,409,978.08	0.16
180	000061	农产品	3,083,800	54,305,718.00	0.16
181	600598	北大荒	4,076,153	53,927,504.19	0.16

182	600219	南山铝业	5,543,663	53,773,531.10	0.16
183	600208	新湖中宝	8,828,097	52,968,582.00	0.16
184	600169	太原重工	2,458,610	52,417,565.20	0.16
185	600108	亚盛集团	7,965,714	52,414,398.12	0.16
186	600649	城投控股	6,586,762	52,364,757.90	0.16
187	600601	方正科技	12,581,882	51,459,897.38	0.15
188	600516	方大炭素	3,666,094	51,361,976.94	0.15
189	600312	平高电气	3,755,741	51,190,749.83	0.15
190	600085	同仁堂	1,492,792	51,172,909.76	0.15
191	600809	山西汾酒	744,592	51,026,889.76	0.15
192	600216	浙江医药	1,548,025	50,419,174.25	0.15
193	600153	建发股份	7,696,610	50,412,795.50	0.15
194	600635	大众公用	7,543,203	50,313,164.01	0.15
195	600118	中国卫星	2,020,873	50,158,067.86	0.15
196	000100	TCL 集团	14,576,670	49,997,978.10	0.15
197	600879	航天电子	3,719,371	49,988,346.24	0.15
198	000876	新希望	2,385,740	49,981,253.00	0.15
199	000652	泰达股份	6,347,006	49,379,706.68	0.15
200	601117	中国化学	8,483,384	49,033,959.52	0.15
201	600500	中化国际	4,120,388	48,826,597.80	0.15
202	000807	云铝股份	4,072,185	48,621,888.90	0.15
203	002092	中泰化学	3,308,535	47,742,160.05	0.14
204	600432	吉恩镍业	1,859,897	47,576,165.26	0.14
205	600239	云南城投	2,541,698	47,199,331.86	0.14
206	600418	江淮汽车	4,432,510	47,117,581.30	0.14
207	600508	上海能源	1,657,163	46,881,141.27	0.14
208	601888	中国国旅	1,513,400	46,869,998.00	0.14
209	600595	中孚实业	3,390,923	46,794,737.40	0.14
210	600808	马钢股份	13,683,680	46,661,348.80	0.14
211	000951	中国重汽	1,683,044	46,552,997.04	0.14
212	600737	中粮屯河	2,882,264	45,683,884.40	0.14
213	600037	歌华有线	3,647,057	45,588,212.50	0.14
214	601158	重庆水务	5,503,126	45,510,852.02	0.14
215	600096	云天化	1,691,475	45,179,297.25	0.13
216	601918	国投新集	3,182,164	44,709,404.20	0.13
217	002146	荣盛发展	3,287,168	44,672,613.12	0.13
218	600546	山煤国际	1,289,832	44,628,187.20	0.13
219	000021	长城开发	3,781,333	44,392,849.42	0.13
220	600316	洪都航空	1,644,361	44,003,100.36	0.13

221	600066	宇通客车	2,086,221	43,873,227.63	0.13
222	600779	水井坊	1,960,451	43,522,012.20	0.13
223	600008	首创股份	6,305,622	42,436,836.06	0.13
224	000059	辽通化工	3,657,438	42,389,706.42	0.13
225	600839	四川长虹	11,425,354	42,273,809.80	0.13
226	002001	新和成	1,664,645	42,032,286.25	0.13
227	000612	焦作万方	1,926,776	42,003,716.80	0.13
228	600596	新安股份	2,725,327	41,479,476.94	0.12
229	600717	天津港	4,800,211	40,033,759.74	0.12
230	600804	鹏博士	4,603,697	39,914,052.99	0.12
231	002028	思源电气	1,512,302	39,728,173.54	0.12
232	600675	中华企业	5,675,694	39,275,802.48	0.12
233	600663	陆家嘴	2,335,531	39,236,920.80	0.12
234	600895	张江高科	4,438,876	38,973,331.28	0.12
235	600481	双良节能	2,321,916	38,543,805.60	0.11
236	000690	宝新能源	6,928,367	38,313,869.51	0.11
237	000968	煤气化	1,472,531	38,241,630.07	0.11
238	000027	深圳能源	3,787,671	38,217,600.39	0.11
239	600210	紫江企业	6,588,715	38,082,772.70	0.11
240	600325	华发股份	3,746,958	37,994,154.12	0.11
241	600528	中铁二局	4,182,393	37,976,128.44	0.11
242	000625	长安汽车	3,965,066	37,707,777.66	0.11
243	600183	生益科技	3,291,614	37,491,483.46	0.11
244	600269	赣粤高速	6,693,686	37,283,831.02	0.11
245	600220	江苏阳光	7,155,992	37,068,038.56	0.11
246	601101	昊华能源	780,768	36,742,942.08	0.11
247	000718	苏宁环球	3,904,189	36,504,167.15	0.11
248	002122	天马股份	2,724,090	36,121,433.40	0.11
249	000780	平庄能源	2,325,806	35,654,605.98	0.11
250	600517	置信电气	2,128,022	35,282,604.76	0.11
251	000046	泛海建设	3,918,682	35,189,764.36	0.10
252	600170	上海建工	2,389,418	34,861,608.62	0.10
253	600026	中海发展	3,626,121	34,810,761.60	0.10
254	000959	首钢股份	7,707,708	34,068,069.36	0.10
255	600718	东软集团	2,111,174	33,863,230.96	0.10
256	600161	天坛生物	1,477,483	33,834,360.70	0.10
257	600380	健康元	3,020,865	33,440,975.55	0.10
258	600456	宝钛股份	1,233,247	33,420,993.70	0.10
259	000900	现代投资	1,601,768	32,916,332.40	0.10

260	000686	东北证券	1,465,983	32,676,761.07	0.10
261	000031	中粮地产	5,198,562	32,387,041.26	0.10
262	600863	内蒙华电	3,407,200	32,300,256.00	0.10
263	600017	日照港	7,790,863	31,786,721.04	0.09
264	600674	川投能源	2,139,156	31,531,159.44	0.09
265	600428	中远航运	3,755,906	31,324,256.04	0.09
266	600266	北京城建	2,548,674	31,119,309.54	0.09
267	600369	西南证券	2,662,768	30,967,991.84	0.09
268	000667	名流置业	10,270,763	30,914,996.63	0.09
269	601369	陕鼓动力	1,252,544	29,810,547.20	0.09
270	600893	航空动力	936,920	29,306,857.60	0.09
271	600151	航天机电	2,195,467	28,870,391.05	0.09
272	600300	维维股份	4,792,300	28,274,570.00	0.08
273	002294	信立泰	390,386	28,181,965.34	0.08
274	000776	广发证券	527,867	28,050,852.38	0.08
275	600033	福建高速	7,865,959	27,924,154.45	0.08
276	601877	正泰电器	1,152,235	27,596,028.25	0.08
277	600611	大众交通	3,584,673	27,351,054.99	0.08
278	600823	世茂股份	2,013,088	27,196,818.88	0.08
279	002415	海康威视	286,639	27,030,057.70	0.08
280	600087	长航油运	5,539,769	26,923,277.34	0.08
281	002244	滨江集团	2,325,060	26,226,676.80	0.08
282	600109	国金证券	1,720,170	25,148,885.40	0.08
283	002405	四维图新	458,933	24,993,491.18	0.07
284	600597	光明乳业	2,405,790	24,683,405.40	0.07
285	601107	四川成渝	3,719,328	24,659,144.64	0.07
286	601268	二重重装	1,937,590	24,239,250.90	0.07
287	600004	白云机场	2,636,923	23,257,660.86	0.07
288	000961	中南建设	2,008,428	22,956,332.04	0.07
289	000927	一汽夏利	2,743,262	22,357,585.30	0.07
290	600006	东风汽车	4,585,920	22,195,852.80	0.07
291	600307	酒钢宏兴	2,345,322	22,163,292.90	0.07
292	600748	上实发展	2,484,121	20,046,856.47	0.06
293	002242	九阳股份	1,308,634	19,721,114.38	0.06
294	601099	太平洋	1,723,540	18,717,644.40	0.06
295	002385	大北农	459,513	18,568,920.33	0.06
296	600350	山东高速	3,856,511	18,009,906.37	0.05
297	000685	中山公用	1,030,093	17,985,423.78	0.05
298	601139	深圳燃气	1,410,249	17,501,190.09	0.05

299	600657	信达地产	2,621,347	16,042,643.64	0.05
-----	--------	------	-----------	---------------	------

注：根据本基金基金合同的约定，本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法。原则上将不低于 90% 的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于 15%。

8.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600816	安信信托	2,016,505	27,424,468.00	0.08
2	002537	海立美达	1,000	40,000.00	0.00
3	601118	海南橡胶	5,000	29,950.00	0.00
4	300156	天立环保	500	29,000.00	0.00
5	300157	恒泰艾普	500	28,500.00	0.00
6	002534	杭锅股份	1,000	26,000.00	0.00
7	300155	安居宝	500	24,500.00	0.00
8	002535	林州重机	500	12,500.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	243,196,422.06	0.62
2	600036	招商银行	233,467,462.52	0.59
3	601328	交通银行	188,618,073.42	0.48
4	601288	农业银行	188,180,402.36	0.48
5	600000	浦发银行	183,753,153.59	0.47
6	600887	伊利股份	176,316,255.03	0.45
7	601166	兴业银行	172,858,165.32	0.44
8	601668	中国建筑	163,330,010.87	0.41
9	601006	大秦铁路	143,940,093.93	0.37
10	601398	工商银行	140,623,446.53	0.36
11	600406	国电南瑞	135,142,427.85	0.34
12	601788	光大证券	132,310,410.98	0.34
13	600276	恒瑞医药	123,578,514.85	0.31
14	601299	中国北车	113,733,828.22	0.29
15	600016	民生银行	109,298,558.98	0.28

16	600999	招商证券	105,153,442.07	0.27
17	600362	江西铜业	104,478,768.01	0.27
18	600104	上海汽车	98,307,101.54	0.25
19	601688	华泰证券	96,873,224.63	0.25
20	600115	东方航空	92,924,045.21	0.24

8.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	291,003,623.78	0.74
2	601318	中国平安	238,083,405.16	0.60
3	601328	交通银行	212,769,748.94	0.54
4	600016	民生银行	206,203,393.24	0.52
5	601398	工商银行	193,554,974.67	0.49
6	601166	兴业银行	181,768,339.69	0.46
7	600900	长江电力	161,467,078.11	0.41
8	600030	中信证券	161,096,693.13	0.41
9	601088	中国神华	142,656,520.40	0.36
10	000002	万科A	138,140,515.51	0.35
11	600000	浦发银行	131,273,592.64	0.33
12	601601	中国太保	126,693,702.80	0.32
13	600104	上海汽车	124,478,573.38	0.32
14	600011	华能国际	123,659,382.45	0.31
15	000063	中兴通讯	108,657,435.84	0.28
16	600276	恒瑞医药	107,951,762.86	0.27
17	000001	深发展A	107,652,000.58	0.27
18	600022	济南钢铁	104,348,313.40	0.26
19	600519	贵州茅台	101,927,521.29	0.26
20	000858	五粮液	100,747,268.96	0.26

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,061,862,050.39
卖出股票收入（成交）总额	10,371,088,586.88

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	1,107,910,000.00	3.30
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
	合计	1,107,910,000.00	3.30

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

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	1001021	10 央行票据 21	2,800,000	273,868,000.00	0.82
2	1001019	10 央行票据 19	2,400,000	234,792,000.00	0.70
3	0801047	08 央行票据 47	1,000,000	100,390,000.00	0.30
4	0801044	08 央行票据 44	1,000,000	100,360,000.00	0.30
5	0801035	08 央行票据 35	1,000,000	100,290,000.00	0.30

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

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

报告期末，本基金未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,013,453.69
2	应收证券清算款	3,321,387.74
3	应收股利	-

4	应收利息	26,893,308.61
5	应收申购款	30,356,504.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	62,584,654.24

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末, 本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 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, 指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.5.2 积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600816	安信信托	27,424,468.00	0.08	重要事项未公告
2	002537	海立美达	40,000.00	0.00	未上市
3	601118	海南橡胶	29,950.00	0.00	未上市
4	300156	天立环保	29,000.00	0.00	未上市
5	300157	恒泰艾普	28,500.00	0.00	未上市

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,673,172	24,920.99	6,525,688,784.67	15.65%	35,171,407,770.44	84.35%

9.2 期末上市基金场内前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	佛山市顺德区蚬华多媒体制品有限公司	55,584,435.00	0.13%
2	中意人寿保险有限公司—传统保险产品—股票账户	54,707,918.00	0.13%
3	青岛国信资产管理有限公司	42,807,300.00	0.10%

4	山西证券—华夏—山西证券汇通启富 1 号集合资产管理计划	38,839,983.00	0.09%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	35,999,781.00	0.09%
6	中意人寿保险有限公司—中石油年金产品—股票账户	31,700,000.00	0.08%
7	深圳市琛达投资有限公司	30,000,000.00	0.07%
8	永安财产保险股份有限公司	29,999,928.00	0.07%
9	中宏人寿保险有限公司	28,370,000.00	0.07%
10	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L-FH002 深	27,508,600.00	0.07%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	3,048,187.39	0.01%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2005 年 8 月 29 日) 基金份额总额	867,126,900.07
本报告期期初基金份额总额	43,393,057,963.84
本报告期基金总申购份额	17,814,794,943.38
减:本报告期基金总赎回份额	19,510,756,352.11
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	41,697,096,555.11

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的审计费 170,000.00 元, 该审计机构已连续 6 年提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内, 本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券股份有限公司	3	2,965,271,171.85	15.66%	2,504,351.72	15.72%	-
安信证券股份有限公司	3	2,449,932,271.07	12.94%	2,082,436.10	13.07%	-
东方证券股份有限公司	1	2,114,088,378.08	11.16%	1,717,715.05	10.78%	-
信达证券股份有限公司	1	1,915,722,484.13	10.11%	1,628,364.12	10.22%	新增
华泰联合证券有限责任公司	2	1,879,533,922.90	9.92%	1,576,908.81	9.90%	-
华融证券股份有限公司	1	905,454,831.73	4.78%	769,635.73	4.83%	新增
国金证券股份有限公司	2	802,113,689.22	4.24%	681,794.55	4.28%	-
平安证券有限责任公司	2	796,207,863.43	4.20%	667,676.70	4.19%	-
瑞银证券有限责任公司	1	794,493,338.95	4.19%	675,317.93	4.24%	-
华宝证券经纪有限责任公司	1	728,078,978.43	3.84%	618,866.02	3.89%	-
中国国际金融有限公司	2	569,447,238.63	3.01%	484,027.02	3.04%	-
渤海证券股份有限公司	1	538,265,356.46	2.84%	457,524.33	2.87%	-
中国建银投资证券有限责任公司	2	353,945,874.89	1.87%	290,000.78	1.82%	-
光大证券股份有限公司	1	350,422,679.41	1.85%	297,858.29	1.87%	-
国元证券股份有限公司	1	329,022,104.48	1.74%	279,668.61	1.76%	新增
国泰君安证券股份有限公司	4	291,545,158.80	1.54%	236,883.96	1.49%	-
东海证券有限责任公司	1	238,307,320.26	1.26%	202,559.57	1.27%	-
海通证券股份有限公司	2	170,513,614.88	0.90%	138,543.70	0.87%	-
长城证券有限责任公司	2	151,394,562.07	0.80%	123,008.95	0.77%	-

北京高华证券有限责任公司	1	148,892,385.39	0.79%	126,559.62	0.79%	-
长江证券股份有限公司	1	134,300,020.68	0.71%	109,119.20	0.69%	-
兴业证券股份有限公司	1	97,061,972.12	0.51%	82,502.71	0.52%	-
英大证券有限责任公司	2	74,680,303.69	0.39%	60,678.02	0.38%	-
申银万国证券股份有限公司	2	53,656,930.59	0.28%	43,596.39	0.27%	-
东北证券股份有限公司	2	33,017,348.11	0.17%	28,064.90	0.18%	-
中银国际证券有限责任公司	2	31,710,148.57	0.17%	26,951.61	0.17%	-
齐鲁证券有限公司	1	23,013,393.47	0.12%	18,698.99	0.12%	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
大通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 1 个
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中信金通证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华西证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
中国民族证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
民生证券有限责任公司	2	-	-	-	-	新增
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增

注 1: 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2: 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范, 在近一年内无重大违规行为;
- (2) 公司财务状况良好;
- (3) 有良好的内控制度, 在业内有良好的声誉;
- (4) 有较强的研究能力, 能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告, 并能根据基金投资的特殊要求, 提供专门的研究报告;
- (5) 建立了广泛的信息网络, 能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议, 并通知基金托管人。

注 3: 江南证券有限责任公司更名为中航证券有限公司。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下开放式基金通过浙商证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年1月4日
2	关于通过浦发银行电子渠道申购嘉实旗下开放式基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年1月8日
3	关于通过中国银行网上银行申购嘉实沪深300指数(LOF)费率优惠调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年1月26日
4	关于开通直销网上交易赎回转认购/申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年1月27日
5	关于增加江苏银行为嘉实沪深300指数(LOF)和嘉实基本面50指数(LOF)代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年2月24日
6	关于旗下开放式基金通过浙商证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年1月4日
7	关于通过浦发银行电子渠道申购嘉实旗下开放式基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年1月8日
8	关于通过中国银行网上银行申购嘉实沪深300指数(LOF)费率优惠调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年1月26日
9	关于开通直销网上交易赎回转认购/申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年1月27日
10	关于增加江苏银行为嘉实沪深300指数(LOF)和嘉实基本面50指数(LOF)代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年2月24日
11	关于成立广州分公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年3月3日
12	关于旗下开放式基金通过江海证券和第一创业证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年3月10日
13	关于开通嘉实基本面50指数(LOF)与嘉实沪深300指数(LOF)场外份额之间转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年3月16日
14	关于直销网上交易赎回转申购业务有关申购费率统一优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年3月17日
15	关于增加东莞银行为嘉实沪深300指数(LOF)代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年3月17日
16	关于嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)基金份额净值计算位数变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年3月23日
17	关于调整旗下开放式基金在浦发银行定投起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年4月9日
18	关于旗下开放式基金通过爱建证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年4月16日

19	关于对兴业银行借记卡持有人开通嘉实直销网上交易定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 21 日
20	关于增加华融证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 5 月 5 日
21	关于增加中国光大银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 5 月 6 日
22	关于增加恒泰证券为嘉实旗下基金代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 5 月 12 日
23	关于旗下开放式基金通过华融证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 5 月 28 日
24	关于旗下开放式基金通过信达证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 6 月 3 日
25	关于通过中国银行网银申购嘉实沪深 300 指数 (LOF) 和嘉实研究精选股票费率优惠调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 6 月 8 日
26	关于旗下开放式基金通过申银万国证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 6 月 24 日
27	关于通过交通银行网上银行申购嘉实旗下开放式基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 7 月 1 日
28	关于旗下开放式基金通过国信证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 7 月 7 日
29	关于直销电话交易开通农行金穗卡、建行龙卡储蓄卡、广发理财通卡、中行广东分行卡认购和申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 7 月 9 日
30	关于旗下开放式基金通过东吴证券和日信证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 7 月 21 日
31	关于农行金穗卡持卡人通过直销网上和电话交易系统在线支付方式申购基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 8 月 20 日
32	关于嘉实基金网上直销汇款支付业务开通范围增加中行、交行、招行及广发银行借记卡持卡人业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 8 月 27 日
33	嘉实 300 和嘉实 50、嘉实 H 股增加乌鲁木齐市商业银行代销机构并开办定投公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 9 月 20 日
34	关于旗下开放式基金通过中投证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 9 月 30 日
35	关于旗下开放式基金通过长江证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 10 月 22 日
36	关于嘉实基金网上直销汇款支付业务开通范围增加邮储银行等 6 家银行借记卡持卡人业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 12 月 3 日
37	关于对中国民生银行借记卡持卡人开通嘉实直销网上交易和电话交易业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2010 年 12 月 31 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实沪深 300 指数证券投资基金募集的文件;
- (2) 《嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- (3) 《嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》;
- (4) 《嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金托管协议》;
- (5) 《嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书》;
- (6) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (7) 报告期内嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 公告的各项原稿。

12.2 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

12.3 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 E-mail: service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2011 年 3 月 28 日