

# 嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

## 2011 年第二季度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2011 年 7 月 20 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 7 月 18 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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 4 月 1 日起至 2011 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	嘉实沪深 300 指数 (LOF) (深交所上市简称: 嘉实 300)
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
报告期末基金份额总额	40,061,703,536.07 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	风险中等，获得证券市场平均收益率。
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

### § 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（2011年4月1日—2011年6月30日）
1. 本期已实现收益	-137,162,190.36
2. 本期利润	-1,377,272,949.64
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0349
4. 期末基金资产净值	31,649,519,798.64
5. 期末基金份额净值	0.7900

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。

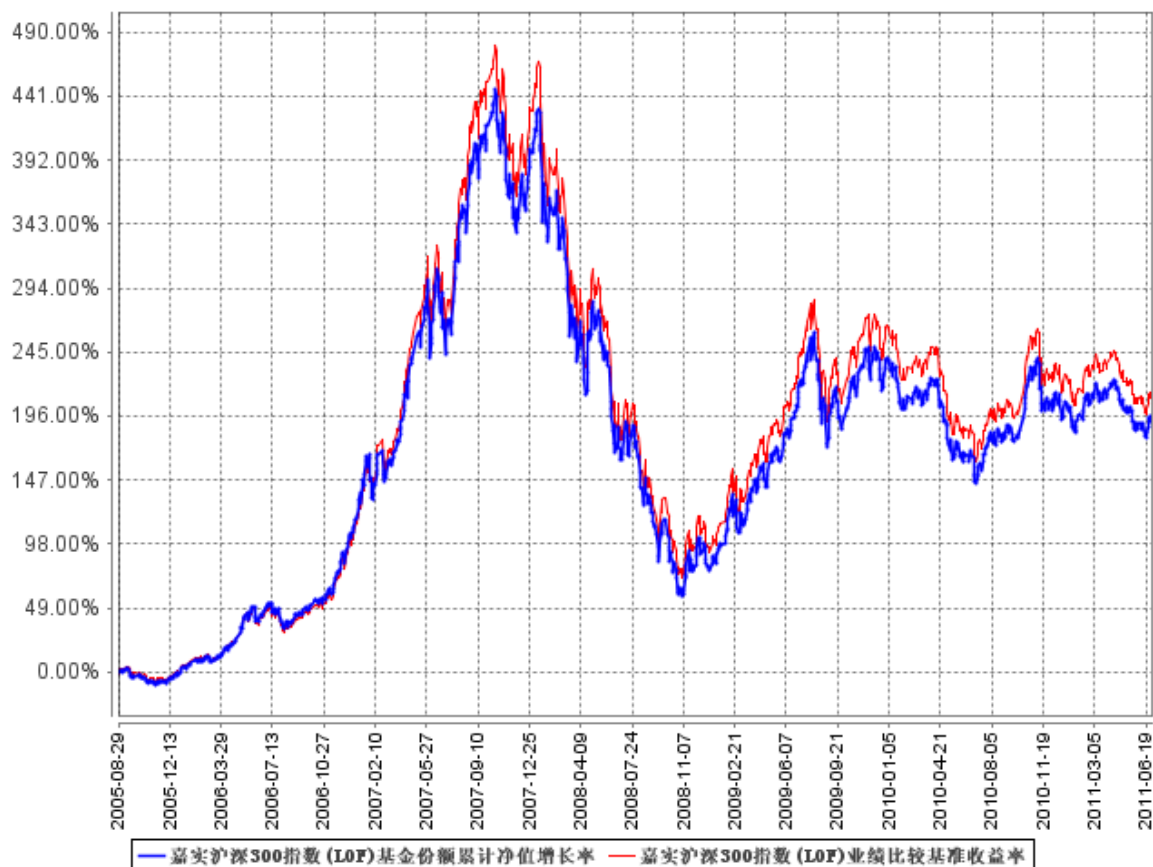
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-4.36%	1.04%	-5.26%	1.04%	0.90%	0.00%

### 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



图：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 (2005 年 8 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日)

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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）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
		任职日期	离任日期		
杨宇	本基金基金经理、公司结构产品投资部总监	2005年8月29日	-	13年	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 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，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 0.03%，年度化拟合偏离度为 0.50%，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样本股分红所带来的影响，由

于本基金所跟踪的基准指数是价格指数，而基金资产相当于全收益指数，价格指数和全收益指数每日的变动幅度不同，是本基金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 0.7900 元；本报告期基金份额净值增长率为-4.36%，业绩比较基准收益率为-5.26%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、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。

## § 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	29,918,474,326.33	94.15
	其中：股票	29,918,474,326.33	94.15
2	固定收益投资	1,200,078,000.00	3.78
	其中：债券	1,200,078,000.00	3.78
	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	488,882,396.52	1.54
6	其他资产	169,195,946.30	0.53
7	合计	31,776,630,669.15	100.00

### 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	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	175,215,138.65	0.55
B	采掘业	3,495,121,407.62	11.04
C	制造业	11,008,831,385.31	34.78
C0	食品、饮料	1,825,192,497.70	5.77
C1	纺织、服装、皮毛	102,608,584.68	0.32
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	742,944,435.90	2.35

C5	电子	333,255,901.37	1.05
C6	金属、非金属	2,760,730,829.44	8.72
C7	机械、设备、仪表	3,905,955,465.78	12.34
C8	医药、生物制品	1,213,303,278.49	3.83
C99	其他制造业	124,840,391.95	0.39
D	电力、煤气及水的生产和供应业	652,300,736.91	2.06
E	建筑业	960,815,416.84	3.04
F	交通运输、仓储业	1,109,073,732.51	3.50
G	信息技术业	958,257,278.70	3.03
H	批发和零售贸易	907,559,997.87	2.87
I	金融、保险业	8,286,698,115.61	26.18
J	房地产业	1,411,905,724.54	4.46
K	社会服务业	251,275,146.75	0.79
L	传播与文化产业	61,202,317.83	0.19
M	综合类	640,217,927.19	2.02
	合计	29,918,474,326.33	94.53

## 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

### 5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	17,650,584	851,993,689.68	2.69
2	600036	招商银行	65,146,414	848,206,310.28	2.68
3	600016	民生银行	118,992,972	681,829,729.56	2.15
4	601328	交通银行	109,654,075	607,483,575.50	1.92
5	600000	浦发银行	58,960,545	580,171,762.80	1.83
6	601166	兴业银行	39,776,470	536,186,815.60	1.69
7	601088	中国神华	17,375,151	523,687,051.14	1.65
8	600030	中信证券	36,676,209	479,724,813.72	1.52
9	601398	工商银行	106,369,924	474,409,861.04	1.50
10	000002	万科A	50,996,218	430,918,042.10	1.36

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%。

### 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	1,200,078,000.00	3.79
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	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,200,078,000.00	3.79

### 5.5 报告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

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	1101019	11 央行票据 19	2,300,000	228,413,000.00	0.72
2	1101023	11 央行票据 23	2,100,000	208,425,000.00	0.66
3	1001070	10 央行票据 70	2,000,000	195,520,000.00	0.62
4	1101021	11 央行票据 21	1,000,000	99,250,000.00	0.31
5	1101034	11 央行票据 34	1,000,000	99,210,000.00	0.31

### 5.6 报告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

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名的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

### 5.8 投资组合报告附注

**5.8.1** 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。

**5.8.2** 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。

#### 5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------



1	存出保证金	2, 210, 019. 06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	43, 902, 256. 32
4	应收利息	12, 341, 486. 94
5	应收申购款	110, 742, 183. 98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	169, 195, 946. 30

#### 5.8.4 报告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。

#### 5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.8.5.1 报告期末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, 本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 5.8.5.2 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

单位: 份

本报告期期初基金份额总额	39, 582, 088, 342. 10
本报告期基金总申购份额	2, 756, 688, 980. 08
减: 本报告期基金总赎回份额	2, 277, 073, 786. 11
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	40, 061, 703, 536. 07

注: 报告期期间基金总申购份额含转换入份额; 总赎回份额含转换出份额。

## § 7 备查文件目录

### 7.1 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 (LOF) 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) 基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6) 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。

## 7.2 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

## 7.3 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, 或发电子邮件, E-mail: [service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司  
2011 年 7 月 20 日