

嘉实沪深 300 指数证券投资基金(LOF)

2011 年半年度报告摘要

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

送出日期：2011 年 8 月 24 日

§ 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。本半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 8 月 19 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

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

§ 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)
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
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	40,061,703,536.07 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%,以实现对沪深 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×95%+银行同业存款收益率×5%
风险收益特征	风险中等,获得证券市场平均收益率

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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	-242,318,045.70
本期利润	-448,901,300.67
加权平均基金份额本期利润	-0.0112
本期加权平均净值利润率	-1.39%
本期基金份额净值增长率	-1.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	-10,472,244,839.52

期末可供分配基金份额利润	-0.2614
期末基金资产净值	31,649,519,798.64
期末基金份额净值	0.7900
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	196.18%

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
过去一个月	2.20%	1.13%	1.36%	1.13%	0.84%	0.00%
过去三个月	-4.36%	1.04%	-5.26%	1.04%	0.90%	0.00%
过去六个月	-1.74%	1.17%	-2.50%	1.17%	0.76%	0.00%
过去一年	18.67%	1.33%	17.93%	1.33%	0.74%	0.00%
过去三年	9.27%	1.93%	9.46%	1.92%	-0.19%	0.01%
自基金合同生效起至今	196.18%	1.96%	214.36%	1.96%	-18.18%	0.00%

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：

$$\text{Benchmark } 0=1000$$

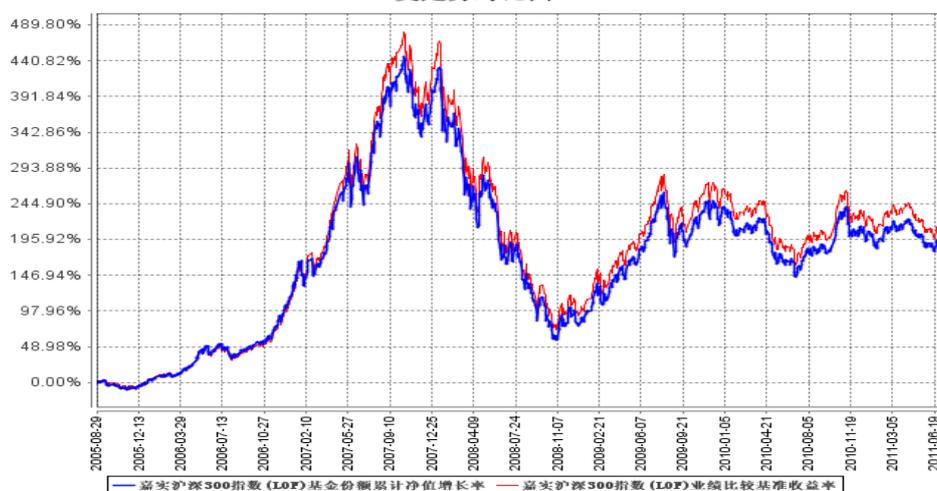
$$\text{Return } t=95\% \times (\text{沪深 300 指数 } t / (\text{沪深 300 指数 } t-1) - 1) + 5\% \times \text{同业存款日收益率}$$

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

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



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。

截止 2011 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式基金、23 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、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票。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 (助理) 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	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 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 0.02%,年度化拟合偏离度为 0.38%,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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金基金份额净值为 0.7900 元;本报告期基金份额净值增长率为-1.74%,同期业绩比较基准收益率为-2.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年上半年,A 股市场在中国通货膨胀走高和紧缩政策逐渐加强的影响下,产生了一定幅度的调整。中长期来看,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。

沪深 300 指数成份股市场代表性强,是中国 A 股市场的中坚力量;沪深 300 指数作为目前股指期货的唯一标的,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、年中和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、交易、基金运营、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,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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本报告 3.1 “本期利润”为 -448,901,300.67 元、“期末可供分配利润”为 -10,472,244,839.52 元、“期末基金份额净值”为 0.7900 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”、“4、基金当期收益应先弥补上期亏损后,才可进行当期收益分配”“6、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值”,因此报告期内本基金未实施分配利润。

§ 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 托管人对半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 半年度财务报表(未经审计)

6.1 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:2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2011 年 6 月 30 日	2010 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	483,619,128.38	659,006,956.47
结算备付金		5,263,268.14	1,181,562.90
存出保证金		2,210,019.06	2,013,453.69
交易性金融资产	6.4.7.2	31,118,552,326.33	32,848,990,671.88
其中: 股票投资		29,918,474,326.33	31,741,080,671.88
基金投资		-	-
债券投资		1,200,078,000.00	1,107,910,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	3,321,387.74
应收利息	6.4.7.5	12,341,486.94	26,893,308.61
应收股利		43,902,256.32	-
应收申购款		110,742,183.98	30,356,504.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		31,776,630,669.15	33,571,763,845.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		87,389,843.82	-
应付赎回款		19,091,368.44	18,778,915.39
应付管理人报酬		12,524,541.80	14,560,553.95
应付托管费		2,504,908.37	2,912,110.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,299,584.87	7,827,082.02
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,300,623.21	1,213,562.70
负债合计		127,110,870.51	45,292,224.87
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	40,061,703,536.07	41,697,096,555.11
未分配利润	6.4.7.10	-8,412,183,737.43	-8,170,624,934.49
所有者权益合计		31,649,519,798.64	33,526,471,620.62
负债和所有者权益总计		31,776,630,669.15	33,571,763,845.49

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7900 元，基金份额总额 40,061,703,536.07 份。

6.2 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-338,253,129.63	-10,165,399,266.35
1. 利息收入		18,864,725.31	12,948,297.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,310,204.75	2,685,285.37
债券利息收入		16,543,999.16	10,263,012.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,521.40	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-155,419,508.84	-215,631,088.87
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-415,973,935.71	-404,240,672.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-9,202,680.00	5,430.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	269,757,106.87	188,604,153.61
3. 公允价值变动收益	6.4.7.16	-206,583,254.97	-9,970,189,751.01
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.17	4,884,908.87	7,473,275.93
二、费用		110,648,171.04	112,584,959.07
1. 管理人报酬		80,295,509.44	85,120,928.23
2. 托管费		16,059,101.92	17,024,185.66
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	14,000,429.63	10,163,054.45
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	293,130.05	276,790.73
三、利润总额		-448,901,300.67	-10,277,984,225.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-448,901,300.67	-10,277,984,225.42

6.3 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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）	41,697,096,555.11	-8,170,624,934.49	33,526,471,620.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-448,901,300.67	-448,901,300.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,635,393,019.04	207,342,497.73	-1,428,050,521.31
其中：1. 基金申购款	5,356,434,489.25	-1,045,992,664.62	4,310,441,824.63
2. 基金赎回款	-6,991,827,508.29	1,253,335,162.35	-5,738,492,345.94
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）	40,061,703,536.07	-8,412,183,737.43	31,649,519,798.64
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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）	-	-10,277,984,225.42	-10,277,984,225.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-849,531,881.23	56,183,576.65	-793,348,304.58
其中：1. 基金申购款	8,027,466,027.89	-1,535,369,949.16	6,492,096,078.73
2. 基金赎回款	-8,876,997,909.12	1,591,553,525.81	-7,285,444,383.31
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）	42,543,526,082.61	-14,221,378,795.37	28,322,147,287.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵学军

基金管理公司负责人

李松林

主管会计工作负责人

王红

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 差错更正的说明

报告期内，本基金不存在重大会计差错事项。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	80,295,509.44	85,120,928.23
其中：支付销售机构的客户维护费	16,023,295.58	14,574,892.92

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 0.5% 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 × 0.5% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	16,059,101.92	17,024,185.66

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

6.4.4.3 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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	336,866,943.84	339,896,987.13	-	-	-	-
上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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	-	-	-	-	-

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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。

6.4.4.4.2 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

本期末（2011 年 6 月 30 日）及上年度末（2010 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 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	
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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	483,619,128.38	2,209,260.16	599,088,693.32	2,622,998.18

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。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.5 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2011 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 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
601998	中信银行	2011 年 6 月 29 日	配股申购期间停牌	4.75	2011 年 7 月 7 日	4.59	12,085,882	85,964,553.77	57,407,939.50	-
000652	泰达股份	2010 年 11 月 22 日	重大事项未公告停牌	7.68	2011 年 7 月 8 日	7.68	6,347,006	74,696,989.74	48,745,006.08	-
600216	浙江医药	2011 年 6 月 27 日	筹划非公开发行股票停牌	31.39	2011 年 7 月 4 日	32.60	1,442,225	39,487,311.00	45,271,442.75	-
000876	新希望	2011 年 6 月 29 日	筹划重大资产重组停牌	19.95	2011 年 7 月 5 日	21.95	2,185,140	26,133,817.27	43,593,543.00	-
600170	上海建工	2011 年 6 月 29 日	筹划重大资产重组停牌	15.59	2011 年 7 月 4 日	16.25	2,188,518	28,023,707.88	34,118,995.62	-
000959	首钢股份	2010 年 10 月 29 日	筹划重大资产重组停牌	4.42	未知	未知	7,707,708	43,285,392.06	34,068,069.36	-
600369	西南证券	2011 年 3 月 1 日	筹划重大资产重组停牌	11.87	2011 年 8 月 16 日	12.49	2,574,968	43,493,903.48	30,564,870.16	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末 (2011 年 6 月 30 日), 本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末 (2011 年 6 月 30 日), 本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	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	其他各项资产	169,195,946.30	0.53
7	合计	31,776,630,669.15	100.00

7.2 期末按行业分类的股票指数投资组合

7.2.1 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	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

7.2.2 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。

7.3 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

7.3.1 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

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	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

7.3.2 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。

注：1、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%。

2、2011 年 6 月 13 日，中证指数有限公司发布《关于调整沪深 300 和中证香港 100 等指数样

本股的公告》，2011 年 7 月 1 日调整沪深 300 等指数样本股，调出名单包括泰达股份（000652）、首钢股份（000959）。期末本基金持有的泰达股份因筹划重大事项自 2010 年 11 月 22 日起至本报告期末停牌，首钢股份因筹划重大资产重组事项自 2010 年 10 月 29 日起至本报告期末停牌。

3、投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（<http://www.jsfund.cn>）的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额前 20 名的股票投资明细

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	000776	广发证券	167,606,888.90	0.50
2	600837	海通证券	154,945,902.72	0.46
3	002304	洋河股份	103,867,599.39	0.31
4	600999	招商证券	100,813,509.45	0.30
5	002073	软控股份	80,253,497.15	0.24
6	601288	农业银行	76,320,210.33	0.23
7	601668	中国建筑	67,401,674.81	0.20
8	601989	中国重工	66,686,212.02	0.20
9	600036	招商银行	56,311,942.13	0.17
10	601600	中国铝业	56,095,231.62	0.17
11	601318	中国平安	54,193,263.92	0.16
12	002106	莱宝高科	53,427,762.41	0.16
13	600859	王府井	51,860,558.20	0.15
14	000869	张裕 A	51,759,902.90	0.15
15	000792	盐湖股份	50,774,750.61	0.15
16	600267	海正药业	49,722,655.75	0.15
17	601118	海南橡胶	47,816,558.49	0.14
18	000012	南玻 A	45,326,998.04	0.14
19	000157	中联重科	42,537,243.24	0.13
20	600016	民生银行	42,443,248.92	0.13

7.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票投资明细

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	133,317,508.23	0.40

2	601318	中国平安	132,015,127.55	0.39
3	600016	民生银行	99,368,040.43	0.30
4	601398	工商银行	91,183,879.79	0.27
5	601328	交通银行	91,145,545.45	0.27
6	600000	浦发银行	90,153,771.85	0.27
7	601166	兴业银行	88,931,373.17	0.27
8	601088	中国神华	72,800,398.86	0.22
9	600030	中信证券	67,838,654.90	0.20
10	000002	万科A	65,514,849.34	0.20
11	600018	上港集团	58,399,731.07	0.17
12	600519	贵州茅台	56,173,682.16	0.17
13	601601	中国太保	55,811,518.05	0.17
14	000858	五粮液	50,514,410.46	0.15
15	600601	方正科技	48,767,475.14	0.15
16	600795	国电电力	45,479,818.25	0.14
17	600015	华夏银行	43,792,274.05	0.13
18	002024	苏宁电器	43,664,675.69	0.13
19	600816	安信信托	42,202,098.04	0.13
20	600031	三一重工	41,161,740.28	0.12

7.4.3 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	3,790,518,717.22
卖出股票收入（成交）总额	4,981,462,852.09

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”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。

7.5 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	1,200,078,000.00	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
---	----	------------------	------

7.6 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	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

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	2,210,019.06
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

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.9.5.1 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。

7.9.5.2 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
1,603,428	24,985.03	5,697,126,166.61	14.22%	34,364,577,369.46	85.78%

8.2 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	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	104,999,967.00	3.18%
2	中国平安财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品	99,999,827.00	3.03%
3	中宏人寿保险有限公司	95,725,448.00	2.90%
4	王荣	81,624,808.00	2.47%
5	佛山市顺德区蚬华多媒体制品有限公司	55,584,435.00	1.68%
6	中意人寿保险有限公司-传统保险产品-股票账户	54,707,918.00	1.66%
7	信达证券-建行-信达满堂红基金优选集合资产管理计划	48,872,255.00	1.48%
8	青岛国信资产管理有限公司	42,807,300.00	1.30%
9	深圳市琛达投资有限公司	40,500,000.00	1.23%
10	华西证券-建行-华西证券融诚 2 号集合资产管理计划	35,987,700.00	1.09%

8.3 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	4,686,743.07	0.01%

§ 9 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	41,697,096,555.11
本报告期基金总申购份额	5,356,434,489.25

减:本报告期基金总赎回份额	6,991,827,508.29
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:本报告期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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2011年5月起,王忠民先生因任期届满并退休,不再担任本基金管理人董事长职务,公司董事兼总经理赵学军先生代任董事长职务;2011年8月起安奎先生任本基金管理人董事长。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内,根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》,李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理;因工作调动,董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司,报告期内未改聘。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
安信证券股份有限公司	3	1,005,921,604.99	11.58%	855,032.34	11.73%	-
长江证券股份有限公司	1	885,280,726.26	10.19%	719,297.56	9.87%	-
光大证券股份有限公司	1	798,328,932.27	9.19%	678,583.28	9.31%	-
中信金通证券有限责任公司	1	699,377,637.60	8.05%	594,466.29	8.15%	-
宏源证券股份有限公司	1	684,457,534.92	7.88%	581,783.41	7.98%	新增
民生证券有限责任公司	2	554,256,913.30	6.38%	471,114.28	6.46%	-
长城证券有限责任公司	2	484,389,527.65	5.58%	406,675.01	5.58%	-
渤海证券股份有限公司	1	468,079,942.22	5.39%	397,872.32	5.46%	-
东方证券股份有限公司	1	462,813,734.63	5.33%	376,038.76	5.16%	-
湘财证券有限责任公司	1	419,932,080.87	4.83%	356,940.47	4.90%	-
广发华福证券有限责任公司	1	411,015,816.16	4.73%	349,362.63	4.79%	-
中信证券股份有限公司	3	423,984,531.45	4.88%	344,494.26	4.73%	-
东北证券股份有限公司	2	380,207,864.13	4.38%	323,174.61	4.43%	-
国金证券股份有限公司	2	311,242,474.71	3.58%	264,553.40	3.63%	-
海通证券股份有限公司	2	292,821,681.23	3.37%	237,920.07	3.26%	-
申银万国证券股份有限公司	2	182,972,353.85	2.11%	148,666.49	2.04%	-
瑞银证券有限责任公司	1	82,156,591.34	0.95%	69,831.82	0.96%	-
新时代证券有限责任公司	1	53,787,138.36	0.62%	45,719.74	0.63%	-
中国建银投资证券有限责任公司	2	55,969,235.21	0.64%	45,475.93	0.62%	-
平安证券有限责任公司	2	28,637,531.05	0.33%	23,268.57	0.32%	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
大通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券经纪有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

华西证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	1	-	-	-	-	-
天源证券经纪有限公司	1	-	-	-	-	新增
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

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: 报告期内, 本基金退租以下交易单元: 英大证券有限责任公司上海交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信金通证券有限责任公司	-	-	130,000,000.00	100.00%	-	-

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 8 月 24 日