

嘉实沪深300指数证券投资基金 (LOF)

2011 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。
本报告自2011年4月1日起至2011年6月30日止。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 基金销售人

§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

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)

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申购费用和赎回费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-③

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

截至本报告期末基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

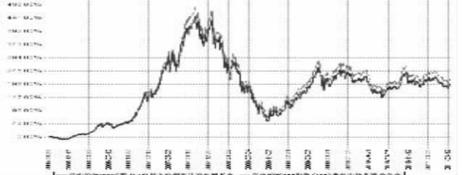


图:嘉实沪深300指数 LOF 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2005年8月29日至2011年6月30日)

注:本基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起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条(C)项规定。在C)投资范围和D)基金投资组合比例限制的前提下,本基金投资组合比例符合基金合同第十四条(C)项规定。
本基金管理人承诺,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。④本基金投资于沪深300指数成份股和备选成份股,且本基金投资于沪深300指数成份股和备选成份股的比例不低于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%。⑤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 魏基经小组 简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 报告期内任职期间基金投资业绩说明

注:①任职日期是指本基金基金合同生效之日;②离任日期是指基金业协会认定或从业人员资格管理规定的相应日期。

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况

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,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求长期利益,本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,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,公平对待下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资组合的投资风格的不同
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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内,本基金跟踪误差为0.01%,年化波动幅度为0.50%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不得超过0.3%的限制。本基金跟踪误差来源主要是样本股分拆上市带来的跟踪误差,由本基金跟踪的基准指数是价格指数,而本基金跟踪的是中证指数,价格指数和收益指数的变动幅度不同,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 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
本基金为一只投资于沪深300指数的被动投资型基金,我们将继续秉承被动化投资策略,积极应对基金申购赎回等因素对跟踪效果带来的冲击,力争进一步降低本基金跟踪误差,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

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 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

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.3 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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.4 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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.5 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资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.7 报告期末本基金投资的股指期货投资情况

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.2.8 报告期末本基金投资的国债期货投资情况

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.2.9 报告期末本基金持有的所有资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.10 报告期末本基金持有的所有衍生品合约

本基金本报告期末未持有衍生品合约。

5.2.11 报告期末本基金持有的所有权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.2.12 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.13 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.14 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.15 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.16 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.17 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.18 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.19 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.20 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.21 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.22 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.23 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.24 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.25 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.26 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.27 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.28 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.29 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.30 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.31 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.32 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.33 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.34 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.35 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.36 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.37 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.38 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.39 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.40 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.41 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.42 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.43 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.44 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.45 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.46 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.47 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.48 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.49 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.50 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.51 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.52 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.53 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.54 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.55 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.56 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.57 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.58 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.59 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.60 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.61 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.62 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.63 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.64 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.65 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.66 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.67 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.68 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.69 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.71 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.72 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.73 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.74 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.75 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.76 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.77 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.78 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.79 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.80 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.81 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.82 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.83 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.84 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.85 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.86 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.87 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.88 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.89 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.90 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.91 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.92 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.93 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.94 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.95 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.96 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.97 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.98 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.99 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.100 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.101 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.102 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.103 报告期末本基金持有的所有权证

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.104 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。