

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

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2011年8月19日复核了本基金的财务指标、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。本报告中财务数据未经审计。
本报告自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name (嘉实沪深300指数证券投资基金), code (160706), and other details.

2.2 基金产品说明

本基金为被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力求复制标的指数的净值增长率,并追求跟踪误差的最小化,力争实现长期稳定的增值。

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: Name and Information. Lists the fund manager (嘉实基金管理有限公司) and custodian (中国银行股份有限公司).

2.4 信息披露方式

基金年度报告摘要刊登在指定网站,投资者可通过指定网站查阅。
基金半年度报告备置地点:北京市西城区德胜门内大街2号嘉实基金大厦8层

§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)

Table with 2 columns: Item and Value. Lists financial metrics like net assets, income, and expenses.

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

Table with 4 columns: Period, Fund Return, Benchmark Return, and Difference. Compares fund performance to benchmark.

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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.3 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.4 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.5 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.6 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.7 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.8 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.9 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.10 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.11 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.12 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.13 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.14 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.15 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.16 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.17 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.18 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.19 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.20 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

Benchmark = 0.95 * Return A + 0.05 * Return B
Return A = 沪深300指数收益率
Return B = 银行同业存款收益率

3.2.21 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

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率*95%+银行同业存款收益率*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。

嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

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有关规定,对本基金管理人投资运作的监督,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内容的真实、准确和完整发表意见

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有关规定,对本基金管理人投资运作的监督,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。

6.1 资产负债表

单位:人民币元
资产负债表: 2011年6月30日

Balance Sheet table with columns: Item, Amount, and Comparison Period. Lists assets and liabilities.

6.2 利润表

单位:人民币元
利润表: 2011年6月30日

Income Statement table with columns: Item, Amount, and Comparison Period. Lists income and expenses.

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

单位:人民币元
所有者权益(基金净值)变动表: 2011年6月30日

Equity Statement table with columns: Item, Amount, and Comparison Period. Lists changes in equity.

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保持一致的说明

6.4.2 差错更正的说明

6.4.3 关联方关系

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易正常业务范围内按一般商业条款订立的

6.4.4.2 通过关联方交易非正常业务范围内的交易

6.4.4.3 关联方交易

6.4.4.4 关联方交易

6.4.4.5 关联方交易

6.4.4.6 关联方交易

6.4.4.7 关联方交易

6.4.4.8 关联方交易

6.4.4.9 关联方交易

6.4.4.10 关联方交易

6.4.4.11 关联方交易

6.4.4.12 关联方交易

6.4.4.13 关联方交易

6.4.4.14 关联方交易

6.4.4.15 关联方交易

6.4.4.16 关联方交易

6.4.4.17 关联方交易

6.4.4.18 关联方交易

6.4.4.19 关联方交易

6.4.4.20 关联方交易

6.4.4.21 关联方交易

6.4.4.22 关联方交易

6.4.4.23 关联方交易

6.4.4.24 关联方交易

6.4.4.25 关联方交易

6.4.4.26 关联方交易

6.4.4.27 关联方交易

6.4.4.28 关联方交易

6.4.4.29 关联方交易

6.4.4.30 关联方交易

6.4.4.31 关联方交易

6.4.4.32 关联方交易

6.4.4.33 关联方交易

6.4.4.34 关联方交易

6.4.4.35 关联方交易

6.4.4.36 关联方交易

6.4.4.37 关联方交易

6.4.4.38 关联方交易

6.4.4.39 关联方交易

6.4.4.40 关联方交易

6.4.4.41 关联方交易

7.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资明细

Table with 4 columns: Stock Name, Quantity, Fair Value, and Proportion. Lists top 5 stocks.

7.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

Table with 4 columns: Stock Name, Quantity, Fair Value, and Proportion. Lists top 10 stocks.

7.3 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

Table with 4 columns: Bond Name, Quantity, Fair Value, and Proportion. Lists top 5 bonds.

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

Table with 4 columns: Bond Name, Quantity, Fair Value, and Proportion. Lists top 10 bonds.

7.5 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

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资产支持证券投资明细

报告期内,本基金未持有资产支持证券投资。

7.7 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.9 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.10 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.11 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.12 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.13 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.14 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.15 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.16 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.17 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.18 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.19 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.20 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.21 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.22 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.23 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.24 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.25 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.26 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.27 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.28 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.29 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.30 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.31 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.32 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.33 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.34 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.35 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.36 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.37 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

报告期内,本基金未持有权证投资。

7.38 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

</