嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)

2011 半年度 报告摘要

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)
基金简称	嘉实基本面50指数(LOF) (深交所上市简称:嘉实50)
基金主代码	160716
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月30日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,428,183,276.25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	2010年2月10日

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资策略,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,追求对标的指数的有效跟踪。
投资策略	采取完全指数复制法,按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证锐联基本面 50 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%
风险收益特征	本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	赵会军
	联系电话	(010)65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010)65182266	(010)66105799

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	-62,360,422.94
本期利润	-25,026,688.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0084
本期加权平均净值利润率	-1.09%
本期基金份额净值增长率	1.56%
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	-855,592,111.94
期末可供分配基金份额利润	-0.2496
期末基金资产净值	2,572,591,164.31
期末基金份额净值	0.7504
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	-24.96%

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	-0.69%	0.99%	-1.85%	1.01%	1.16%	-0.02%
过去三个月	-4.05%	0.97%	-4.92%	0.98%	0.87%	-0.01%
过去六个月	1.56%	1.04%	1.09%	1.06%	0.47%	-0.02%
过去一年	5.25%	1.22%	5.67%	1.22%	-0.42%	0.00%
自基金合同生效起至今	-24.96%	1.31%	-24.47%	1.34%	-0.49%	-0.03%

注:本基金业绩比较基准为中证锐联基本面 50 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%。中证锐联基本面50指数以基本面指标来衡量上市公司的经济规模,选取其中最大的50家A股上市公司作为样本,且样本个股的权重配置与其经济规模相适应。该指数综合反映了中国证券市场基本面良好企业的整体状况,适合作为本基金的标的指数。

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%*(中证锐联基本面50指数t/中证锐联基本面50指数t-1)+5%*银行同业存款每日收益率

Benchmark t =(1+Return t)*Benchmark t-1

其中t=1,2,3,…..。

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

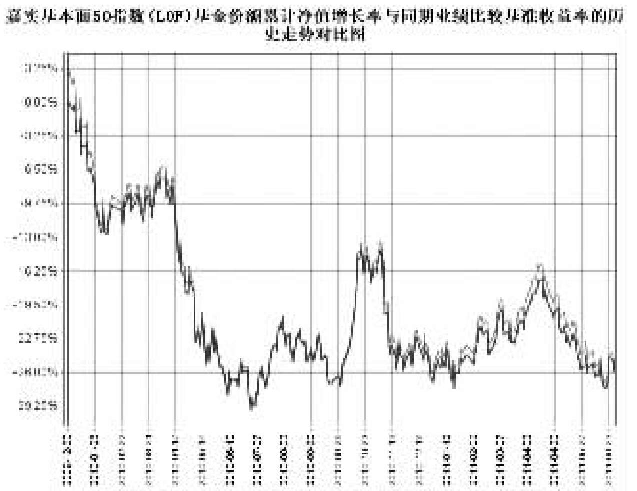

图:嘉实基本面50指数(LOF)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2009年12月30日至2011年6月30日)

注:本基金基金合同生效日为2009年12月30日。按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6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(十一(三)投资范围和(七)2、基金投资组合限制)的有关约定。

§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		
杨阳	本基金基金经理	2009年12月30日	-	11	曾任贝尔斯登高级工程师,HBK投资公司高级工程师/交易操盘手,Citadel投资集团高级数量分析师,高盛集团高级数量分析师。2008年3月加入嘉实基金任高级数量分析师。宾夕法尼亚州立大学硕士,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遵规守信情况的说明

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、《嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)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

报告期内,本基金日均跟踪误差为0.05%,年度化拟合偏离度为0.80%,符合本基金基金合同中约定的日均跟踪误差不超过0.35%的限制。本基金跟踪误差来源主要是由于本基金的限制投资股票的替代选择,样本股分红以及样本股调整的冲击所带来的。

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0.7504元;本报告期基金份额净值增长率为1.56%,同期业绩比较基准收益率为1.09%。

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。

基本面50指数为首只内地基本面指数,以 4 个基本面指标(营业收入、现金流、净资产、分红)来衡量的经济规模最大的覆盖沪深两地市场50 家 A 股上市公司为样本。

作为被动管理的指数基金,本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下,将继续秉承指数化投资管理策略,积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差,力争投资回报与业绩基准保持一致。

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历。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-25,026,688.81元、“期末可供分配基金份额利润”为-0.2496元、“期末基金份额净值”为0.7504元,以及本基金基金合同第十五部分三、收益分配原则 “3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值”的约定,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

2011年上半年,本基金托管人在对嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2011年上半年,嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)未进行利润分配。

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

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)2011年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:嘉实中证锐联基本面50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 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	121,807,167.03	28,821,287.36
结算备付金		1,870,523.54	475,704.37
存出保证金		131,016.75	334,851.27
交易性金融资产	6.4.7.2	2,472,238,206.58	1,778,507,524.37
其中:股票投资		2,422,613,206.58	1,708,304,524.37
基金投资		-	-
债券投资		49,625,000.00	70,203,000.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	324,274.83	2,446,428.78
应收股利		4,580,510.75	-
应收申购款		986,868.41	625,621.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,601,938,567.89	1,811,211,417.75
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		21,852,836.07	-
应付赎回款		3,162,201.65	1,210,000.95
应付管理人报酬		2,134,699.02	1,583,106.31
应付托管费		384,245.81	284,959.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	981,261.46	391,752.19
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	832,159.57	558,055.47
负债合计		29,347,403.58	4,027,874.07
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,428,183,276.25	2,445,785,195.01
未分配利润	6.4.7.10	-855,592,111.94	-638,601,651.33
所有者权益合计		2,572,591,164.31	1,807,183,543.68
负债和所有者权益总计		2,601,938,567.89	1,811,211,417.75

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值0.7504元,基金份额总额3,428,183,276.25份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实中证锐联基本面50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		-8,014,453.28	-901,372,551.07
1.利息收入		1,338,864.29	2,291,492.89
其中:存款利息收入	6.4.7.11	281,463.22	1,229,269.27
债券利息收入		1,050,719.88	1,062,223.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,681.19	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-47,115,665.00	-129,520,141.97
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-88,596,966.96	-149,911,997.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-56,405.48	141,999.77
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	41,537,707.44	20,249,856.12
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	37,333,734.13	-774,956,027.58
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	428,613.30	812,125.59
二、费用		17,012,235.53	21,427,604.38
1.管理人报酬		11,297,103.32	13,772,695.03
2.托管费		2,033,478.62	2,479,085.09
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	2,334,374.11	3,495,812.83
5.利息支出		87,798.79	227,627.84
其中:卖出回购金融资产支出		87,798.79	227,627.84
6.其他费用	6.4.7.19	1,259,480.69	1,452,383.59
三、利润总额		-25,026,688.81	-922,800,155.45
减:所得税费用		-	-
四、净利润		-25,026,688.81	-922,800,155.45

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实中证锐联基本面50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)	2,445,785,195.01	-638,601,651.33	1,807,183,543.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-25,026,688.81	-25,026,688.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	982,398,081.24	-191,963,771.80	790,434,309.44
其中:1.基金申购款	1,531,978,982.53	-321,638,401.58	1,210,340,580.95
2.基金赎回款	-549,580,901.29	129,674,629.78	-419,906,271.51
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)	3,428,183,276.25	-855,592,111.94	2,572,591,164.31
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)	3,437,029,943.95	-658,661.40	3,436,371,282.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-922,800,155.45	-922,800,155.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-458,767,227.72	67,524,864.33	-391,242,363.39
其中:1.基金申购款	317,385,538.24	-58,932,239.66	258,453,298.58
2.基金赎回款	-776,152,765.96	126,457,103.99	-649,695,661.97
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)	2,978,262,716.23	-855,933,952.52	2,122,328,763.71

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______ ______李松林______ ____王红____

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

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
中国工商银行股份有限公司 (中国工商银行)	基金托管人、基金代销机构
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

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

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券有限责任公司	-	-	556,536,622.07	19.72%

注:本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国都证券有限责任公司	-	-	89,146,916.00	100.00%

注:本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.4.1.3债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.4.1.4权证交易

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权证交易。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券有限责任公司	473,054.36	19.82%	473,054.36	22.19%

注:(1)本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金无应支付关联方的佣金。(2)上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费后的净额列示。债券交易不计佣金。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	11,297,103.32	13,772,695.03
其中:支付销售机构的客户维护费	1,746,868.49	1,357,436.52

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1.0%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 1.0% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

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
当期发生的基金应支付的托管费	2,033,478.62	2,479,085.09

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.18%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×0.18% / 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

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),本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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),基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位:人民币元

关联方名称	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国都证券有限责任公司	50,000,750.00	1.46%	50,000,750.00	2.04%

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	121,807,167.03	246,064.26	56,817,737.49	1,194,071.13

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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	1,649,400	11,545,750.78	7,834,650.00	-

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	2,422,613,206.58	93.11
	其中:股票	2,422,613,206.58	93.11
2	固定收益投资	49,625,000.00	1.91
	其中:债券	49,625,000.00	1.91
	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	123,677,690.57	4.75
6	其他各项资产	6,022,670.74	0.23
7	合计	2,601,938,567.89	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	-	-
B	采掘业	236,206,744.09	9.18
C	制造业	416,969,782.57	16.21
C0	食品、饮料	19,606,399.67	0.76
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	-	-
C6	金属、非金属	351,760,913.62	13.67
C7	机械、设备、仪表	36,119,363.56	1.40
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	9,483,105.72	0.37
D	电力、煤气及水的生产和供应业	91,358,411.67	3.55
E	建筑业	198,404,663.52	7.71
F	交通运输、仓储业	103,602,194.28	4.03
G	信息技术业	113,424,575.25	4.41
H	批发和零售贸易	53,088,537.30	2.06
I	金融、保险业	1,127,334,153.30	43.82
J	房地产业	82,224,144.60	3.20
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,422,613,206.58	94.17

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	600036	招商银行	10,445,277	135,997,506.54	5.29
2	601328	交通银行	24,052,104	133,248,656.16	5.18
3	600050	中国联通	21,604,681	113,424,575.25	4.41
4	600016	民生银行	19,790,380	113,398,877.40	4.41
5	601288	农业银行	38,628,736	108,160,460.80	4.20
6	600019	宝钢股份	17,490,559	105,468,070.77	4.10
7	601318	中国平安	1,910,925	92,240,349.75	3.59
8	601668	中国建筑	22,839,026	92,041,274.78	3.58
9	600000	浦发银行	8,459,245	83,238,970.80	3.24
10	000002	万 科A	9,730,668	82,224,144.60	3.20

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)本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票等,成份股及备选股投资比例不低于基金资产的90%。(2)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	601288	农业银行	106,093,960.78	5.87
2	600036	招商银行	66,748,669.97	3.69
3	601328	交通银行	61,403,197.34	3.40
4	600019	宝钢股份	56,304,603.66	3.12
5	601988	中国银行	52,675,508.61	2.91
6	600050	中国联通	49,177,530.21	2.72
7	600016	民生银行	44,731,140.78	2.48
8	601668	中国建筑	43,362,714.74	2.40
9	600837	海通证券	43,085,218.39	2.38
10	601166	兴业银行	42,172,689.97	2.33
11	601318	中国平安	38,057,348.19	2.11
12	600000	浦发银行	35,620,324.86	1.97
13	600005	武钢股份	33,680,637.75	1.86
14	000002	万 科A	32,315,240.03	1.79
15	600030	中信证券	31,500,046.47	1.74
16	600028	中国石化	29,795,822.88	1.65
17	601088	中国神华	29,298,201.73	1.62
18	601006	大秦铁路	26,287,061.01	1.45
19	601169	北京银行	25,025,230.11	1.38
20	601857	中国石油	21,403,830.66	1.18

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	601988	中国银行	79,296,700.65	4.39
2	601166	兴业银行	35,149,886.76	1.95
3	600058	五矿发展	33,246,775.07	1.84
4	600019	宝钢股份	30,910,544.42	1.71
5	600642	申能股份	29,670,365.84	1.64
6	600177	雅戈尔	25,025,363.84	1.38
7	601788	光大证券	16,923,323.16	0.94
8	600519	贵州茅台	13,669,636.15	0.76
9	601328	交通银行	13,334,557.77	0.74
10	600050	中国联通	13,156,023.02	0.73
11	600036	招商银行	13,153,113.52	0.73
12	600016	民生银行	11,637,705.79	0.64
13	601318	中国平安	9,718,012.22	0.54
14	600005	武钢股份	9,626,438.54	0.53
15	600000	浦发银行	9,045,202.00	0.50
16	000002	万 科A	8,557,581.40	0.47
17	600018	上港集团	8,503,919.10	0.47
18	600028	中国石化	7,905,666.81	0.44
19	600030	中信证券	7,595,374.53	0.42
20	601088	中国神华	7,570,520.02	0.42

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	1,251,644,807.71
卖出股票收入(成交)总额	484,531,582.67

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	49,625,000.00	1.93
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	49,625,000.00	1.93

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	1101023	11央行票据23	500,000	49,625,000.00	1.93

注:报告期末,本基金仅持有上述1只债券。

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	131,016.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	4,580,510.75
4	应收利息	324,274.83
5	应收申购款	986,868.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,022,670.74

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
31,864	107,587.98	1,439,334,995.65	41.99%	1,988,848,280.60	58.01%

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	国泰君安证券股份有限公司	10,002,000.00	7.17%
2	东方科学仪器进出口集团有限公司	9,920,300.00	7.11%
3	贵州省贵财投资有限责任公司	9,700,000.00	6.95%
4	吴荣坚	3,207,819.00	2.30%
5	肖玲	2,300,222.00	1.65%
6	周传英	2,000,100.00	1.43%
7	上海五角场黄金珠宝城实业发展有限公司	1,500,000.00	1.08%
8	李东岳	1,350,735.00	0.97%
9	孙军	1,000,190.00	0.72%
10	欧治华	1,000,175.00	0.72%

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	1,301,132.92	0.04%

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年12月30日)基金份额总额	3,437,029,943.95
本报告期期初基金份额总额	2,445,785,195.01
本报告期基金总申购份额	1,531,978,982.53
减:本报告期基金总赎回份额	549,580,901.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,428,183,276.25

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。

§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重大人事变动情况

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	
国信证券股份有限公司	1	1,162,392,204.84	67.33%	988,051.70	67.56%	-
中国国际金融有限公司	1	250,599,320.56	14.52%	213,008.65	14.56%	-
北京高华证券有限责任公司	2	182,696,160.87	10.58%	155,291.53	10.62%	-
中信证券股份有限公司	2	130,670,991.31	7.57%	106,170.29	7.26%	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国建银投资证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
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	1	-	-	-	-	-

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。

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。

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
国信证券股份有限公司	22,334,000.00	100.00%	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	80,000,000.00	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