

## 嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)

## [2009]第四季度报告

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  
报告期截至日:2010年1月21日

§ 1 重要提示

基金管理人和基金托管人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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性负责。基金托管人以书面形式对本基金合同规定，于2010年1月19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重要信息，保证复核结果与本报告一致。

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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金于2009年10月1日起至2009年12月31日。

§ 2 基本产品概况

基金简称:嘉实沪深300指数(LOF)(深市上市简称:嘉实300)

基金代码: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:43,391,057,633.84份

基金资产净值:10,938,426.55元

基金份额净值:0.00026元

投资目标:本基金主要通过投资于沪深300指数成分股，谋求超过中国证券市场所分享中国经济持续、稳定、快速发展的成果。

投资策略:本基金主要通过投资于沪深300指数成分股，所采取的策略，按照成份股在沪深300指数中的基准权重进行投资。

风险收益特征:本基金为股票型基金，风险上采用指数复制法，按照成份股在沪深300指数中的基准权重进行投资。

基金资产净值:10,938,426.55元

基金份额净值:0.00026元

风险等级:中等风险

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

报告期(2009年10月1日至2009年12月31日)

1 本期已实现收益 7,938,426.55

2 本期利润 6,180,722,966.87

3 加权平均基金份额本期利润 0.1404

4 期末基金份额净值 39,393,479.87,17.24

5 期末基金份额总额 0.9088

6 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

7 期末可供分配利润 0.00026元

8 期末基金资产净值 10,938,426.55元

9 期末基金份额净值 0.00026元

10 期末基金资产总值 10,938,426.55元

11 期末基金负债总额 -0.00026元

12 期末基金份额净值 10,938,426.55元

13 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

14 期末基金资产净值 10,938,426.55元

15 期末基金份额净值 0.00026元

16 期末可供分配利润 0.00026元

17 期末基金资产总值 10,938,426.55元

18 期末基金负债总额 -0.00026元

19 期末基金份额净值 10,938,426.55元

20 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

21 期末基金资产净值 10,938,426.55元

22 期末基金份额净值 0.00026元

23 期末可供分配利润 0.00026元

24 期末基金资产总值 10,938,426.55元

25 期末基金负债总额 -0.00026元

26 期末基金份额净值 10,938,426.55元

27 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

28 期末基金资产净值 10,938,426.55元

29 期末基金份额净值 0.00026元

30 期末可供分配利润 0.00026元

31 期末基金资产总值 10,938,426.55元

32 期末基金负债总额 -0.00026元

33 期末基金份额净值 10,938,426.55元

34 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

35 期末基金资产净值 10,938,426.55元

36 期末基金份额净值 0.00026元

37 期末可供分配利润 0.00026元

38 期末基金资产总值 10,938,426.55元

39 期末基金负债总额 -0.00026元

40 期末基金份额净值 10,938,426.55元

41 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

42 期末基金资产净值 10,938,426.55元

43 期末基金份额净值 0.00026元

44 期末可供分配利润 0.00026元

45 期末基金资产总值 10,938,426.55元

46 期末基金负债总额 -0.00026元

47 期末基金份额净值 10,938,426.55元

48 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

49 期末基金资产净值 10,938,426.55元

50 期末基金份额净值 0.00026元

51 期末可供分配利润 0.00026元

52 期末基金资产总值 10,938,426.55元

53 期末基金负债总额 -0.00026元

54 期末基金份额净值 10,938,426.55元

55 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

56 期末基金资产净值 10,938,426.55元

57 期末基金份额净值 0.00026元

58 期末可供分配利润 0.00026元

59 期末基金资产总值 10,938,426.55元

60 期末基金负债总额 -0.00026元

61 期末基金份额净值 10,938,426.55元

62 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

63 期末基金资产净值 10,938,426.55元

64 期末基金份额净值 0.00026元

65 期末可供分配利润 0.00026元

66 期末基金资产总值 10,938,426.55元

67 期末基金负债总额 -0.00026元

68 期末基金份额净值 10,938,426.55元

69 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

70 期末基金资产净值 10,938,426.55元

71 期末基金份额净值 0.00026元

72 期末可供分配利润 0.00026元

73 期末基金资产总值 10,938,426.55元

74 期末基金负债总额 -0.00026元

75 期末基金份额净值 10,938,426.55元

76 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

77 期末基金资产净值 10,938,426.55元

78 期末基金份额净值 0.00026元

79 期末可供分配利润 0.00026元

80 期末基金资产总值 10,938,426.55元

81 期末基金负债总额 -0.00026元

82 期末基金份额净值 10,938,426.55元

83 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

84 期末基金资产净值 10,938,426.55元

85 期末基金份额净值 0.00026元

86 期末可供分配利润 0.00026元

87 期末基金资产总值 10,938,426.55元

88 期末基金负债总额 -0.00026元

89 期末基金份额净值 10,938,426.55元

90 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

91 期末基金资产净值 10,938,426.55元

92 期末基金份额净值 0.00026元

93 期末可供分配利润 0.00026元

94 期末基金资产总值 10,938,426.55元

95 期末基金负债总额 -0.00026元

96 期末基金份额净值 10,938,426.55元

97 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

98 期末基金资产净值 10,938,426.55元

99 期末基金份额净值 0.00026元

100 期末可供分配利润 0.00026元

101 期末基金资产总值 10,938,426.55元

102 期末基金负债总额 -0.00026元

103 期末基金份额净值 10,938,426.55元

104 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

105 期末基金资产净值 10,938,426.55元

106 期末基金份额净值 0.00026元

107 期末可供分配利润 0.00026元

108 期末基金资产总值 10,938,426.55元

109 期末基金负债总额 -0.00026元

110 期末基金份额净值 10,938,426.55元

111 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

112 期末基金资产净值 10,938,426.55元

113 期末基金份额净值 0.00026元

114 期末可供分配利润 0.00026元

115 期末基金资产总值 10,938,426.55元

116 期末基金负债总额 -0.00026元

117 期末基金份额净值 10,938,426.55元

118 期末可供分配基金份额总额 0.00026元

119 期末基金资产净值 10,938,426.55元

120 期末基金份额净值 0.00026元

121 期末可供分配利润 0