

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
报告期截止日：2013年6月30日

重要提示

基金管理人的董事会、监事会对本报告所载资料不承担虚假记载、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。本年度报告经审计，于2013年8月26日报告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、托管人报告和投资组合报告等信息，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，否则愿意承担法律责任。

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。本年度报告经审计，于2013年8月26日报告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、托管人报告和投资组合报告等信息，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人和基金托管人保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，否则愿意承担法律责任。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金简介

基金基本情况	
基金名称	嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)
基金简称	嘉实沪深300ETF联接(LOF)(场内简称：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9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	39,909,952,153.77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

2.1 本基金基本情况	
基金名称	嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)
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9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	39,909,952,153.77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	
基金名称	嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159919
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年5月7日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年5月28日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.3 基金产品说明	
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不超过±0.3%，以实现对沪深300指数的有效跟踪，力求实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在正常市场情况下，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±0.3%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。	
本基金的跟踪误差的计算方法，即完全按照指数的成份股组成及其权重进行调整。	
业绩比较基准	沪深300指数增长±9.5%+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

2.4 目标基金产品说明	
本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。	
本基金采取完全复制法，即完全按照指数的成份股组成及其权重进行调整。	
业绩比较基准	沪深300指数
风险收益特征	风险中等，获得证券市场平均收益率

2.5 基金管理人和基金托管人	
项目	基金管理人
名称	嘉实基金管理有限公司
姓名	胡勇钦
信息披露负责人	董晓霞
联系电话	(010)65215588
电子邮箱	service@fund.e-china.com
客户服务电话	400-600-8800
传真	(010)65182266

2.6 信息披露方式	
登载基金半年度报告的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告置地	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
报告期	2013年1月1日至2013年6月30日

2.7 主要财务指标和净值表现	
金额单位：人民币元	
3.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 – 2013年6月30日)
本期已实现收益	419,396,297.46
本期利润	-2,882,237,005.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0695
本期平均基金份额利润	-10.23%
本期基金份额净值增长率	-11.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2013年6月30日)
本期可供分配利润	-18,949,956,682.92
期末可供分配基金份额利润	-0.4748
期末基金资产净值	23,927,367,354.54
期末基金份额净值	0.5995
3.1.3 期末指标	报告期(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	124.76%
3.1.4 主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期利润	419,396,297.46
本期利润	-2,882,237,005.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0695
本期平均基金份额利润	-10.23%
本期基金份额净值增长率	-11.07%
3.1.5 期末数据和指标	报告期(2013年6月30日)
本期可供分配利润	-18,949,956,682.92
期末可供分配基金份额利润	-0.4748
期末基金资产净值	23,927,367,354.54
期末基金份额净值	0.5995
3.1.6 期末指标	报告期(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	124.76%
3.1.7 主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期利润	419,396,297.46
本期利润	-2,882,237,005.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0695
本期平均基金份额利润	-10.23%
本期基金份额净值增长率	-11.07%
3.2 期末数据和指标	报告期(2013年6月30日)
本期可供分配利润	-18,949,956,682.92
期末可供分配基金份额利润	-0.4748
期末基金资产净值	23,927,367,354.54
期末基金份额净值	0.5995
3.3 期末指标	报告期(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	124.76%
3.4 主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期利润	419,396,297.46
本期利润	-2,882,237,005.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0695
本期平均基金份额利润	-10.23%
本期基金份额净值增长率	-11.07%
3.5 期末数据和指标	报告期(2013年6月30日)
本期可供分配利润	-18,949,956,682.92
期末可供分配基金份额利润	-0.4748
期末基金资产净值	23,927,367,354.54
期末基金份额净值	0.5995
3.6 期末指标	报告期(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	124.76%
3.7 主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期利润	419,396,297.46
本期利润	-2,882,237,005.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0695
本期平均基金份额利润	-10.23%
本期基金份额净值增长率	-11.07%
3.8 期末数据和指标	报告期(2013年6月30日)
本期可供分配利润	-18,949,956,682.92
期末可供分配基金份额利润	-0.4748
期末基金资产净值	23,927,367,354.54
期末基金份额净值	0.5995
3.9 期末指标	报告期(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	124.76%
3.10 主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期利润	419,396,297.46
本期利润	-2,882,237,005.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0695
本期平均基金份额利润	-10.23%
本期基金份额净值增长率	-11.07%
3.11 期末数据和指标	报告期(2013年6月30日)
本期可供分配利润	-18,949,956,682.92
期末可供分配基金份额利润	-0.4748
期末基金资产净值	23,927,367,354.54
期末基金份额净值	0.5995
3.12 期末指标	报告期(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	124.76%
3.13 主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期利润	419,396,297.46
本期利润	-2,882,237,005.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0695
本期平均基金份额利润	-10.23%
本期基金份额净值增长率	-11.07%
3.14 期末数据和指标	报告期(2013年6月30日)
本期可供分配利润	-18,949,956,682.92
期末可供分配基金份额利润	-0.4748
期末基金资产净值	23,927,367,354.54
期末基金份额净值	0.5995
3.15 期末指标	报告期(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	124.76%
3.16 主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期利润	419,396,297.46
本期利润	-2,882,237,005.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0695
本期平均基金份额利润	-10.23%
本期基金份额净值增长率	-11.07%
3.17 期末数据和指标	报告期(2013年6月30日)
本期可供分配利润	-18,949,956,682.92
期末可供分配基金份额利润	-0.4748
期末基金资产净值	23,927,367,354.54
期末基金份额净值	0.5995
3.18 期末指标	报告期(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	124.76%
3.19 主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期利润	419,396,297.46
本期利润	-2,882,237,005.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0695
本期平均基金份额利润	-10.23%
本期基金份额净值增长率	-11.07%
3.20 期末数据和指标	报告期(2013年6月30日)
本期可供分配利润	-18,949,956,682.92
期末可供分配基金份额利润	-0.4748
期末基金资产净值	23,927,367,354.54
期末基金份额净值	0.5995
3.21 期末指标	报告期(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	124.76%
3.2	