

# 嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

## 2014 半年度报告摘要

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:2014年08月20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法律责任。在审议本年度报告时,个别董事未能出席,其授权代表代表其行使表决权。  
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2014年8月20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、误导性陈述或重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则履行义务,但是该承诺不能视为基金管理人就基金资产未来净值或回报水平作出任何承诺。  
基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的投资风险提示及更新。  
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,应当阅读半年度报告正文。本报告中所载资料未经审计。  
本报告自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

基金名称	基金简称	基金代码
嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	嘉实沪深300ETF联接(LOF)	嘉实300
场内简称	嘉实300	160706
基金运作方式	上市型契约开放式	2005年8月29日
基金合同生效日	嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	深圳证券交易所
基金托管人	嘉实基金管理有限公司	深圳证券交易所
报告期末基金份额总额	36,801,023,781.76份	2005-10-17
基金合同存续期	不定期	2005-10-17
基金上市证券交易所	深圳证券交易所	2005-10-17
2.1 目标基金基本情况		
基金名称	嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金	159919
基金代码	159919	2012年5月7日
基金运作方式	交易型开放式	2012年5月28日
基金合同生效日	2012年5月7日	2012年5月28日
基金上市证券交易所	深圳证券交易所	2012年5月28日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
基金托管人名称	嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
2.2 基金产品说明		
投资目标	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量化的风险管理手段,力求跟踪本基金的投资标的沪深300指数表现,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。	
投资策略	本基金为跟踪ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪,即在正常市场情况下,本基金资产的净值增长率与标的指数的净值增长率之间的差异控制在0.3%以内,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降低跟踪误差,使之符合本基金的跟踪目标。	
业绩比较基准	沪深300指数增长率×95%+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	
2.2.1 目标基金产品说明		
投资目标	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。	
投资策略	本基金采用完全复制法,即完全复制标的指数的成份股构成及其权重构建基金投资组合,并随着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	沪深300 指数	
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币型基金。本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币型基金。	

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

基金管理人	基金托管人
嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
名称	姓名
信息披露负责人	联系人电话
电子邮箱	电子邮箱
客户服务热线	400-600-8800
传真	(010)65182266
2.4 信息披露方式	基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点	北京市建明大街北大街华贸大厦嘉实基金管理有限公司

未托管人复核范围内,投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6.1 资产负债表  
单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
银行存款	6.4.7.1	487,180,294.76	279,599,171.55
结算备付金		23,967,333.28	19,439,810.27
存出保证金		1,269,644.09	930,667.80
交易性金融资产	6.4.7.2	21,656,420,093.46	23,906,662,893.84
其中:股票投资		616,870,601.85	96,325,606.58
基金投资		20,398,821,491.61	22,838,949,570.18
债券投资		640,728,000.00	965,387,117.08
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		16,714,470.22	73,643,007.44
应收利息	6.4.7.5	17,660,347.16	21,854,321.16
应收股利		-	-
应收申购款		1,204,812.67	10,665,375.21
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		22,308,308,903.77	24,310,800,962.11
负债和所有者权益			
短期借款		-	-
应付账款		-	-
应付利息		-	-
应付股利		-	-
应付债券		-	-
长期应付款		-	-
专项应付款		-	-
其他负债		-	-
所有者权益		-	-
实收资本		-	-
资本公积		-	-
未分配利润		-	-
所有者权益合计		-	-
负债和所有者权益总计		-	-

注:1. 本期资产负债表于2014年6月30日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
2. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
3. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
4. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
5. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
6. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
7. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
8. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
9. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
10. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
11. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
12. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
13. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
14. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
15. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
16. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
17. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
18. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
19. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
20. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
21. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
22. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
23. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
24. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
25. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
26. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
27. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
28. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
29. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
30. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
31. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
32. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
33. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
34. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
35. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
36. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
37. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
38. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
39. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
40. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
41. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
42. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
43. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
44. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
45. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
46. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
47. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
48. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
49. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
50. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
51. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
52. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
53. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
54. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
55. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
56. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
57. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
58. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
59. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
60. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
61. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
62. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
63. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
64. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
65. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
66. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
67. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
68. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
69. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,023.78份,单位净值1.63元。  
70. 截至资产负债表日,基金资产净值60,020.76元,基金份额总额36,801,0