

# 嘉实沪深 300 指数证券投资基金(LOF) 2006年第三季度报告

**S1 重要提示**  
基金管理人的董事会及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责任。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2006年10月25日核对了本报告中的  
财务指标、净值表现和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。

本报告期为2006年7月1日起至2006年9月30日止。本报告期中的财务资料未经审计。

## S2 基金产品概况

|                |  |
|----------------|--|
| (1) 基金名称       | 嘉实沪深 300   |
| (2) 基金代码       | 160706   |
| (3) 基金运作方式     | 上市契约型开放式   |
| (4) 基金合同生效日    | 2005年8月29日   |
| (5) 报告期末基金份额总额 | 288,493,957.46份  |
| (6) 投资目标       | 本基金通过主动指数化投资，通过严格的投资纪律和做量化的风险管理手段，力争<br>控制本基金的净值增长率与基金份额净值基准之差的平均绝对误差小于0.3%，以实现对沪深<br>300指数的有效跟踪，谋求通过中长期市场趋势分析分层调整仓位、精选股票，力争实现成果。<br>本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在沪深300指数中的基准<br>权重构建投资组合。 |
| (7) 投资策略       | 本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在沪深300指数中的基准<br>权重构建投资组合。  |
| (8) 业绩比较基准     | 沪深300指数量化收益率×95%+银行同期存款收益率×5%  |
| (9) 风险收益特征     | 本基金通过指数复制法进行被动指数化投资，力图控制本基金净值增长率与业绩基准差<br>额之差的平均跟踪误差小于0.3%。  |
| (10) 基金管理人     | 嘉实基金管理有限公司   |
| (11) 基金托管人     | 中国银行股份有限公司   |

## S3 主要财务指标和基金净值表现

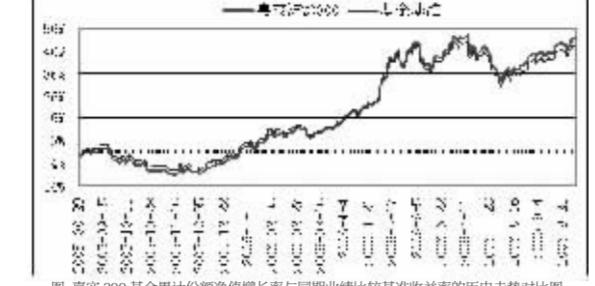
| 序号 | 主要财务指标    | 2006年7月1日至2006年9月30日 |
|----|-----------|----------------------|
| 1  | 基金份额净收益   | 8,820,445.64         |
| 2  | 基金份额本期净收益 | 0.031                |
| 3  | 期末基金份额净值  | 360,491,580.03       |
| 4  | 基金份额净值    | 1215                 |

上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将低于所列数字。

## S3.2 基金净值表现

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益③ | 业绩比较基准收益标准差④ | ①-③⑤  | ②-④⑥   |
|-------|--------|-----------|-----------|--------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.25%  | 1.27%     | 0.68%     | 1.28%        | 0.57% | -0.01% |

(2) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准收益率的变动比较



图：嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，与同期业绩比较基准收益率的变动比较

注：按基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。报告期末本基金的各项投资比例符合基金合同第七条“（二）投资范围”中“（七）投资禁止行为”之规定。

(3) 前十名股票

本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建投资组合。

(4) 业绩比较基准

沪深300指数量化收益率×95%+银行同期存款收益率×5%

(5) 风险收益特征

本基金通过指数复制法进行被动指数化投资，力图控制本基金净值增长率与业绩基准差

额之差的平均跟踪误差小于0.3%。

(6) 基金管理人

嘉实基金管理有限公司

(7) 基金托管人

中国银行股份有限公司

## S5 投资组合报告

### 5.1 报告期末未持有股票的组合情况

| 资产类别         | 金额(元)          | 占基金资产的比例 |
|--------------|----------------|----------|
| 股票           | 332,496,220.35 | 94.49%   |
| 债券           | 9,880,466.66   | 2.81%    |
| 银行存款及清算备付金合计 | 6,995,042.98   | 1.99%    |
| 应收证券清算款      | 2,006,910.64   | 0.57%    |
| 权证           | —              | —        |
| 其他资产         | 521,358.10     | 0.14%    |
| 合计           | 361,899,590.11 | 100.00%  |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 行业               | 股票市值(元)        | 市值占基金资产净值比例 |
|------------------|----------------|-------------|
| A 航空、航天、渔业       | 1,366,738.92   | 0.39%       |
| B 采掘业            | 14,686,819.93  | 4.19%       |
| C 制造业            | 139,197,364.81 | 39.72%      |
| D 食品、饮料、皮货       | 23,467,441.17  | 6.70%       |
| E 电子、通信、计算机      | 4,863,956.65   | 1.39%       |
| F 化工、油墨、橡胶       | 1,658,511.45   | 0.47%       |
| G 医药、生物、塑胶、塑料    | 14,451,626.69  | 4.24%       |
| H 纺织、服装、服饰       | 9,326,456.54   | 2.65%       |
| I 五金、珠宝、钟表       | 4,461,768.96   | 1.28%       |
| J 建筑、冶金、仪器仪表     | 31,742,716.59  | 9.06%       |
| K 化学、农药、生物制品     | 9,611,171.41   | 2.74%       |
| L 其他制造业          | 1,667,200.46   | 0.49%       |
| M 制造业            | 21,947,698.29  | 6.26%       |
| N 电力、煤气及水的生产和供应业 | 2,906,582.27   | 0.83%       |
| O 交通运输、仓储和邮电通信业  | 27,972,974.92  | 7.98%       |
| P 信息技术业          | 23,526,075.90  | 6.71%       |
| Q 批发和零售贸易        | 13,309,277.00  | 3.89%       |
| R 金融、保险业         | 45,566,377.34  | 13.00%      |
| S 证券业            | 16,789,167.61  | 4.79%       |
| T 保险业            | 7,120,719.69   | 2.05%       |
| U 信托业            | 3,056,373.13   | 0.98%       |
| V 企业服务           | 15,103,384.44  | 4.31%       |
| W 信息技术业          | 32,496,220.35  | 94.97%      |
| 合计               | 323,496,220.35 | 100.00%     |

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 行业            | 股票市值(元)        | 市值占基金资产净值比例 |
|---------------|----------------|-------------|
| A 航空、航天、渔业    | 1,810,804      | 17.99%      |
| B 采掘业         | 8,154,152.82   | 23.33%      |
| C 制造业         | 533,090        | 1.57%       |
| D 食品、饮料、皮货    | 1,019,276      | 2.20%       |
| E 电子、通信、计算机   | 6,406,567.70   | 1.85%       |
| F 化工、油墨、橡胶    | 981,084        | 1.84%       |
| G 医药、生物、塑胶、塑料 | 6,445,712.88   | 1.84%       |
| H 纺织、服装、服饰    | 1,258,504      | 1.80%       |
| I 五金、珠宝、钟表    | 5,765,125.84   | 1.65%       |
| J 建筑、冶金、仪器仪表  | 112,546        | 0.33%       |
| K 信托业         | 5,305,190.07   | 1.52%       |
| L 保险业         | 323,240        | 0.10%       |
| 合计            | 323,496,220.35 | 100.00%     |

5.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 行业            | 股票市值(元)        | 市值占基金资产净值比例 |
|---------------|----------------|-------------|
| A 航空、航天、渔业    | 1,347,390      | 14.15%      |
| B 采掘业         | 39,789,388.00  | 6.15%       |
| C 制造业         | 7,980,357.30   | 2.28%       |
| D 食品、饮料、皮货    | 1,019,276      | 0.28%       |
| E 电子、通信、计算机   | 6,406,567.70   | 0.18%       |
| F 化工、油墨、橡胶    | 981,084        | 0.18%       |
| G 医药、生物、塑胶、塑料 | 6,445,712.88   | 0.18%       |
| H 纺织、服装、服饰    | 1,258,504      | 0.18%       |
| I 五金、珠宝、钟表    | 5,765,125.84   | 0.18%       |
| J 建筑、冶金、仪器仪表  | 112,546        | 0.03%       |
| K 信托业         | 5,305,190.07   | 0.15%       |
| L 保险业         | 323,240        | 0.10%       |
| 合计            | 323,496,220.35 | 100.00%     |

5.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 行业            | 股票市值(元)        | 市值占基金资产净值比例 |
|---------------|----------------|-------------|
| A 航空、航天、渔业    | 1,810,804      | 14.15%      |
| B 采掘业         | 39,789,388.00  | 6.15%       |
| C 制造业         | 7,980,357.30   | 2.28%       |
| D 食品、饮料、皮货    | 1,019,276      | 0.28%       |
| E 电子、通信、计算机   | 6,406,567.70   | 0.18%       |
| F 化工、油墨、橡胶    | 981,084        | 0.18%       |
| G 医药、生物、塑胶、塑料 | 6,445,712.88   | 0.18%       |
| H 纺织、服装、服饰    | 1,258,504      | 0.18%       |
| I 五金、珠宝、钟表    | 5,765,125.84   | 0.18%       |
| J 建筑、冶金、仪器仪表  | 112,546        | 0.03%       |
| K 信托业         | 5,305,190.07   | 0.15%       |
| L 保险业         | 323,240        | 0.10%       |
| 合计            | 323,496,220.35 | 100.00%     |

5.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 行业 |
<th
| --- |