

嘉实沪深300 指数证券投资基金 (LOF)

2007 年年度报告摘要

基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构的名称...

Table with 5 columns: Item, Unit, 2007年12月31日, 2006年12月31日, 2007年12月31日/2006年12月31日. Contains financial data.

Table with 5 columns: Item, Unit, 2007年度, 2006年度. Contains performance metrics.

Table with 5 columns: Item, Unit, 2007年度, 2006年度. Contains financial statements.

Table with 5 columns: Item, Unit, 2007年度, 2006年度. Contains fund statistics.

Table with 2 columns: Item, Content. Contains basic information.

1.2 基金产品说明: 本基金为主动式指数化投资, 通过严格的积极投资策略分散化的风险...

1.3 基金管理人: 嘉实基金管理有限公司, 注册地址: 上海浦东新区世纪大道1602号...

1.4 基金托管人: 中国银行股份有限公司, 注册地址: 北京市西城区复兴门内大街1号...

1.5 信息披露: 本基金年度报告正文存放在基金管理人网站上...

2. 主要财务指标: 本期期末基金份额净值 1.227, 本期期末基金份额净值增长率...

Table with 5 columns: Period, Net Asset Value, Net Asset Value Growth, Return to Shareholders, Return to Shareholders (Net of Fees).

Table with 5 columns: Period, Net Asset Value, Net Asset Value Growth, Return to Shareholders, Return to Shareholders (Net of Fees).

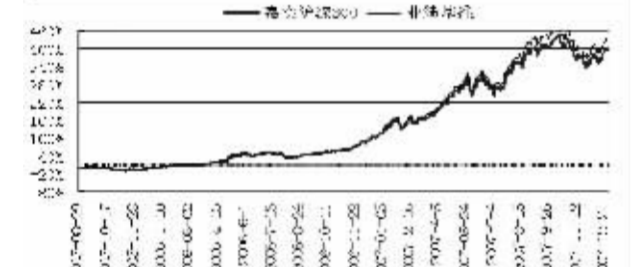


图 1: 嘉实 300 基金基金份额净值增长率及跟踪误差比较历史走势图

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...

Table with 5 columns: Period, Net Asset Value, Net Asset Value Growth, Return to Shareholders, Return to Shareholders (Net of Fees).

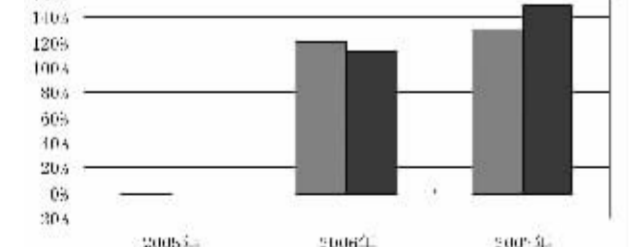


图 2: 嘉实 300 基金净值增长率与业绩比较基准历史走势图

Table with 5 columns: Period, Net Asset Value, Net Asset Value Growth, Return to Shareholders, Return to Shareholders (Net of Fees).

8.3 持有人服务: 基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构的名称...

8.4 持有人大会: 基金份额持有人大会, 基金份额持有人大会的召集和召开...

8.5 基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构的名称...

8.6 基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构的名称...

8.7 基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构的名称...

8.8 基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构的名称...

8.9 基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构的名称...

8.10 基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构的名称...

买入股票于交易日确认为股票投资, 2007 年 7 月 1 日之前, 股票投资成本按交易日的全部价款...

2. 债券投资: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入证券交易所交易的债券于交易日确认为债券投资...

3. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

4. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

5. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

6. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

7. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

8. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

9. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

10. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

11. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

12. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

13. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

14. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

15. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

16. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

17. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

18. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

19. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

20. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

21. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

22. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

23. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

24. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

25. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

26. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

27. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

28. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

29. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

30. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

31. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

32. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

33. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

34. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

35. 其他金融工具: 2007 年 7 月 1 日之前, 买入债券于交易日确认为债券投资...

Table with 3 columns: Industry, Market Value, Market Value Ratio. Lists various industries.

Table with 3 columns: Industry, Market Value, Market Value Ratio. Lists various industries.

Table with 4 columns: Rank, Stock Name, Shareholder Name, Market Value Ratio. Lists top 10 stocks.

注: 投资者需要了解本报告期内基金投资的所有关联交易, 尚需经托管人审核后由本基金管理人网站公布。

Table with 3 columns: Rank, Stock Name, Shareholder Name. Lists top 10 stocks.

Table with 3 columns: Rank, Stock Name, Shareholder Name. Lists top 10 stocks.

Table with 3 columns: Rank, Stock Name, Shareholder Name. Lists top 10 stocks.

Table with 3 columns: Rank, Stock Name, Shareholder Name. Lists top 10 stocks.

Table with 3 columns: Rank, Stock Name, Shareholder Name. Lists top 10 stocks.

Table with 3 columns: Rank, Stock Name, Shareholder Name. Lists top 10 stocks.

Table with 3 columns: Rank, Stock Name, Shareholder Name. Lists top 10 stocks.

Table with 3 columns: Rank, Stock Name, Shareholder Name. Lists top 10 stocks.

Table with 3 columns: Rank, Stock Name, Shareholder Name. Lists top 10 stocks.

Table with 3 columns: Rank, Stock Name, Shareholder Name. Lists top 10 stocks.

Table with 3 columns: Rank, Stock Name, Shareholder Name. Lists top 10 stocks.