

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF)

2011 第二季度 报告

2011年6月30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
报告送出日期:2011年7月20日

§1 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。

基金任人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月18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预示其未来表现,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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告自2011年6月1日起至2011年6月30日止。

基金名称	嘉实 H 股指数 QDII-LOF (深交所上市简称:恒生 H 股)
基金代码	160717
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年9月30日
报告期末基金份额总额	209,123,476.10份
基金净值表现	本报告期末基金份额净值 1.1748, 累计净值 1.1748, 本报告期间净值增长率 4.02%, 同期业绩比较基准收益率 4.11%, 业绩比较基准差 -0.09%。
投资组合	本基金投资于境外证券市场,主要投资于恒生中国企业指数成份股及备选成份股。本基金投资于恒生中国企业指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 90%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险和较高预期收益。
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
境外资产托管人	英文名称:Stan Suter Bank and Trust Company 中文名称:美国道富银行

序号	名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
6	货币工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,991,778.62	8.92
8	其他资产	1,906,630.05	0.89
9	合计	192,283,705.35	100.00

国家/地区	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
香港	173,448,059.43	93.52
合计	173,448,059.43	93.52

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	42,050,665.70	22.67
金融	12,455,364.02	6.72
工业	6,818,161.31	3.68
非必需消费品	5,040,672.52	2.72
必需消费品	897,151.66	0.48
医疗保健	1,991,799.23	0.75
信息技术	1,108,450.69	0.63
公用事业	4,727,849.49	2.55
电信服务	1,861,232.09	1.00
合计	173,448,059.43	93.52

注:本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准 GICS 进行行业分类。

5.3.2 报告期末按投资品种分类的股票及存托凭证投资组合

截至报告期末,本基金持有的股票及存托凭证投资组合如下:

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资组合

序号	公司名称(中文)	代码	所在证券市场	所属国家/地区	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	1398 HK	香港证券交易所	中国香港	3,375,000	16,587,703.43	8.94
2	PetroChina Co. Ltd.	857 HK	香港证券交易所	中国香港	1,718,000	16,258,869.56	8.77
3	Bank of China Ltd.	3988 HK	香港证券交易所	中国香港	5,104,000	16,086,990.34	8.67
4	China Life Insurance Co. Ltd.	2628 HK	香港证券交易所	中国香港	606,000	13,405,381.75	7.23
5	Bank of Communications Co., Ltd.	3328 HK	香港证券交易所	中国香港	1,854,000	11,486,584.93	6.19
6	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd.	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	139,500	9,321,483.05	5.03
7	Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	香港证券交易所	中国香港	1,366,000	8,894,824.56	4.80
8	China Shouhuai Energy Co. Ltd.	1088 HK	香港证券交易所	中国香港	277,000	8,546,309.25	4.61
9	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	香港证券交易所	中国香港	524,000	8,192,454.94	4.42
10	China CITIC Bank Corporation Ltd.	998 HK	香港证券交易所	中国香港	1,698,000	6,848,640.19	3.69

5.4.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资组合

截至报告期末,本基金持有的股票及存托凭证投资组合如下:

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

截至报告期末,本基金未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

截至报告期末,本基金未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资

截至报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资组合

截至报告期末,本基金未持有金融衍生品。

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张冠民	基金经理	2010年9月30日	-	10年	2000年10月加入嘉实基金管理有限公司,在研究部从事宏观研究工作。2008年起任公司结构性产品投资策略制定分析师,从事量化投资策略研究与工作。具有多年基金从业经历,中国国籍。

序号	项目	金额(人民币元)
1	转出证券款	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,891,510.56
4	应收利息	2,284.46
5	应收申购款	12,843.03
6	其他应收款	-
7	持有待售资产	-
8	其他	-
9	合计	1,906,630.05

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	173,448,059.43	93.52
2	其中:普通股	173,448,059.43	93.52
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	其他资产	16,991,778.62	8.92
7	其中:银行存款	16,991,778.62	8.92
8	其他资产	1,906,630.05	0.99

嘉实基金管理有限公司 2011年7月20日

嘉实服务增值行业证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30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
报告送出日期:2011年7月20日

§1 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。

基金任人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月18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预示其未来表现,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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告自2011年4月1日起至2011年6月30日止。

基金名称	嘉实服务增值行业混合
基金代码	070006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年4月1日
报告期末基金份额总额	1,852,231,033.36份
基金净值表现	本报告期末基金份额净值 1.1748, 本报告期间净值增长率 3.04%, 同期业绩比较基准收益率 3.41%, 业绩比较基准差 -0.37%。
投资组合	本基金投资于境内证券市场,主要投资于符合本基金投资策略的上市公司股票。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险和较高预期收益。
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

序号	名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	3,375,000	16,587,703.43
2	PetroChina Co. Ltd.	1,718,000	16,258,869.56
3	Bank of China Ltd.	5,104,000	16,086,990.34
4	China Life Insurance Co. Ltd.	606,000	13,405,381.75
5	Bank of Communications Co., Ltd.	1,854,000	11,486,584.93

5.4.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资组合

截至报告期末,本基金持有的股票及存托凭证投资组合如下:

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

截至报告期末,本基金未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

截至报告期末,本基金未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资

截至报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资组合

截至报告期末,本基金未持有金融衍生品。

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈勤	基金经理	2008年3月20日	-	9年	曾任银河证券资产管理部研究员、嘉实基金管理有限公司研究部研究员、嘉实基金管理有限公司基金经理。具有多年基金从业经历,中国国籍。

序号	项目	金额(人民币元)
1	转出证券款	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,891,510.56
4	应收利息	2,284.46
5	应收申购款	12,843.03
6	其他应收款	-
7	持有待售资产	-
8	其他	-
9	合计	1,906,630.05

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	173,448,059.43	93.52
2	其中:普通股	173,448,059.43	93.52
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	其他资产	16,991,778.62	8.92
7	其中:银行存款	16,991,778.62	8.92
8	其他资产	1,906,630.05	0.99

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	173,448,059.43	93.52
2	其中:普通股	173,448,059.43	93.52
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	其他资产	16,991,778.62	8.92
7	其中:银行存款	16,991,778.62	8.92
8	其他资产	1,906,630.05	0.99

嘉实基金管理有限公司 2011年7月20日

嘉实海外中国股票证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30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
报告送出日期:2011年7月20日

§1 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。

基金任人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月18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预示其未来表现,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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告自2011年4月1日起至2011年6月30日止。

基金名称	嘉实海外中国股票 (QDII)
基金代码	070012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月12日
报告期末基金份额总额	19,801,952.116份
基金净值表现	本报告期末基金份额净值 1.1748, 本报告期间净值增长率 1.53%, 同期业绩比较基准收益率 1.23%, 业绩比较基准差 0.30%。
投资组合	本基金投资于境外证券市场,主要投资于符合本基金投资策略的上市公司股票。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险和较高预期收益。
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
境外资产托管人	英文名称:Bank of China (Hong Kong) Limited 中文名称:中国银行(香港)有限公司

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
江澜	基金经理	2009年10月31日	-	13年	曾任德意志证券 DB Securities 的证券分析师,曾任 UBS Securities 的证券分析师,2008年3月加盟嘉实基金管理有限公司任基金经理。美国波士顿大学(Boston University)工商管理硕士,具有多年基金从业经历,中国国籍。

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	17,784,614,612.23	89.82
2	其中:普通股	17,726,997,866.83	89.38
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	其他资产	57,616,745.40	0.44
7	持有待售资产	-	-
8	其他	-	-
9	合计	17,842,231,357.63	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	17,784,614,612.23	89.82
2	其中:普通股	17,726,997,866.83	89.38
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	其他资产	57,616,745.40	0.44
7	持有待售资产	-	-
8	其他	-	-
9	合计	17,842,231,357.63	100.00

代码	行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	139,930,238.20	1.87
B	制造业	629,199,203.62	8.40
C	采矿业	3,531,073,768.74	47.17
CO	纺织、化纤	974,575,255.47	13.02
C1	钢铁、有色金属	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	443,405,434.67	5.92
C5	电子	154,020,511.13	6.87
C6	金属、非金属	650,705,604.87	8.69
C7	机械、设备、仪表	796,087,170.06	10.63
C8	医药、生物制品	152,279,792.54	2.03
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	135,728,077.11	1.81
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	520,766,454.10	6.96
H	批发和零售贸易	221,046,221.83	2.95
I	金融、保险业	445,136,707.31	5.95
K	房地产业	498,281,439.10	6.66
L	综合类	69,888,284.40	0.93
M	信息与文化传播业	75,627,337.75	1.01
N	合计	6,266,617,732.16	83.71

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	600000	浦发银行	30,788,755	302,961,349.20	4.05
2	600515	上汽集团	8,471,353	301,580,166.80	4.03
3	600019	贵州茅台	1,259,261	267,786,666.43	3.58
4	600858	五粮液	7,251,323	259,017,257.56	3.46
5	600833	三爱康美	36,588,368	234,551,438.88	3.13
6	002475	伊立浦	5,257,861	189,598,467.66	2.53
7	600887	伊莉莎白	11,370,050	189,311,322.50	2.53
8	600048	保利地产	17,089,578	187,311,462.22	2.51
9	600585	海螺水泥	6,624,671	181,900,866.96	2.46
10	600449	晋美药业	4,753,736	165,952,923.76	2.22

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债09附息1	央行票据	-	255,390,000.00	3.41
2	金融债09附息1	其中:政策性金融债	-	-	-
3	企业债09附息1	企业债	-	-	-
4	企业债09附息2	企业债	-	-	-
5	企业债09附息3	企业债	-	-	-
6	可转债09附息1	可转债	-	-	-
7	可转债09附息2	可转债	-	-	-
8	可转债09附息3	可转债	-	-	-
9	合计	企业债、可转债	-	255,390,000.00	3.41

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	1101023	11央行票据23	1,600,000	158,800,000.00	2.12
2	1101018	11央行票据18	1,000,000	96,590,000.00	1.29

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债09附息1	央行票据	-	255,390,000.00	3.41
2	金融债09附息1	其中:政策性金融债	-	-	-
3	企业债09附息1	企业债	-	-	-
4	企业债09附息2	企业债	-	-	-
5	企业债09附息3	企业债	-	-	-
6	可转债09附息1	可转债	-	-	-
7	可转债09附息2	可转债	-	-	-
8	可转债09附息3	可转债	-	-	-
9	合计	企业债、可转债	-	255,390,000.00	3.41

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	1101023	11央行票据23	1,600,000	158,800,000.00	2.12
2	1101018	11央行票据18	1,000,000	96,590,000.00	1.29

序号	项目	名称	金额(元)
1	持有待售资产	-	9,340,728.92
2	应收证券清算款	-	27,767,724.77
3	应收股利	-	1,568,020.44
4	应收利息	-	1,900,517.46
5	应收申购款	-	2,237,532.53
6	其他应收款	-	-
7	持有待售资产	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	42,814,224.11

序号	项目	名称	金额(元)
1	持有待售资产	-	9,340,728.92
2	应收证券清算款	-	27,767,724.77
3	应收股利	-	1,568,020.44
4	应收利息	-	1,900,517.46
5	应收申购款	-	2,237,532.53
6	其他应收款	-	-
7	持有待售资产	-	-
8	其他		