

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2011年8月24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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月19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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金管理人提醒投资者基金投资的长期性和波动性,并提示投资者根据自身的风险承受能力审慎选择投资品种,基金管理人提醒投资者基金投资的长期性和波动性,并提示投资者根据自身的风险承受能力审慎选择投资品种。

本报告期自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

§2 基金简介

Table with 2 columns: 基金基本情况, 基金产品说明. Includes details like 基金名称, 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, etc.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes names and contact information for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 境外资产托管人. Includes details for State Street Bank and Trust Company.

Table with 2 columns: 信息披露, 客户服务. Includes contact info for 信息披露负责人 and 客户服务电话.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes details for 嘉实基金管理有限公司 and 中国建设银行股份有限公司.

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF)

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

和相关工作经历,报告期内,基金经理参加估值专业委员会,但不介入基金日常估值业务;参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;与估值相关的机构为香港交易所等。

4.7 管理人:嘉实恒生中国企业指数证券投资基金
根据本报告 3.1 期末可供分配基金份额净值为-0.1131元、期末基金份额净值为0.8869元,以及本基金合同(十九)C收益分配原则)3.基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值”的约定,因此报告期内本基金未实施分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵循诚信原则,严格按照《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人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、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表
会计主体:嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)
报告截止日:2011年6月30日

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末. Includes 应付证券清算款, 应收利息, 应收股利, etc.

Table with 4 columns: 关联方名称, 当期期末, 占当期期末, 期末应付, 占期末应付. Includes 德意志证券亚洲有限公司.

注:上述应付账款市场利率计算,该类佣金的范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究服务和市场信息服务。

6.4.4.2 关联方报酬
6.4.4.2.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期. Includes 当期发生的基金应支付的托管费, 其中:支付销售机构的客户维护费.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期. Includes 当期发生的基金应支付的托管费.

注:支付基金管理人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本期(2011年1月1日至2011年6月30日),基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本期(2011年6月30日)及上年度末(2010年12月31日),其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
单位:人民币元

Table with 4 columns: 关联方名称, 2011年1月1日至2011年6月30日, 期末余额, 当期利息收入. Includes 中国建设银行, 美国富国银行.

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人美国富国银行保管,按适用利率计提。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销的情况
本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.5 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.5.1 因认购新股增发发债而于期末持有的流通受限证券
本期(2011年6月30日),本基金未持有因认购新股增发发债而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
本期(2011年6月30日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 银行间市场债券正回购
本期(2011年6月30日),本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购
本期(2011年6月30日),本基金无交易所市场债券正回购余额。

7.1 期末基金资产组合情况
单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Includes 权益投资, 其中:普通股票, 2. 基金投资, etc.

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布
单位:人民币元

Table with 3 columns: 国家(地区), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes 香港, 合计.

7.3 期末按行业分类的权益投资组合
7.3.1 期末按行业分类的权益投资组合
单位:人民币元

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes 能源, 原材料, 工业, etc.

7.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细
7.3.2.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细
单位:人民币元

Table with 6 columns: 序号, 公司名称(英文), 公司名称(中文), 证券代码, 所在证券市场, 所属国家(地区), 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
单位:人民币元

Table with 6 columns: 序号, 公司名称(英文), 公司名称(中文), 证券代码, 所在证券市场, 所属国家(地区), 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.4.2 积极投资资产按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
7.4.2.1 积极投资资产按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
单位:人民币元

Table with 6 columns: 序号, 公司名称(英文), 公司名称(中文), 证券代码, 所在证券市场, 所属国家(地区), 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.4.2.2 积极投资资产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明细
7.4.2.2.1 积极投资资产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明细
单位:人民币元

Table with 6 columns: 序号, 公司名称(英文), 公司名称(中文), 证券代码, 所在证券市场, 所属国家(地区), 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.5 累计买入金额前20名的权益投资明细
单位:人民币元

Table with 6 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%).

7.5.1 累计买入金额前20名的权益投资明细
单位:人民币元

Table with 6 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%).

7.5.2 累计卖出金额前20名的权益投资明细
单位:人民币元

Table with 6 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%).

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额
单位:人民币元

Table with 2 columns: 买入成本(成交总额), 卖出收入(成交总额). Includes 28,771,993.20, 146,754,541.88.

注:7.5.1项“买入金额”、7.5.2项“卖出金额”及7.5.3项“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额(成交价款)成交数量*成交价,不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合
报告期末,本基金未持有债券。

7.7 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明细
报告期末,本基金未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
报告期末,本基金未持有资产支持证券。

7.9 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明细
单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes 1. 股指期货, China CITIC Bank Corporation Ltd.

注:报告期末,本基金持有上述1只金融衍生品投资。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名投资明细
报告期末,本基金未持有基金。

7.11 投资组合报告附注
7.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未发生内幕交易,且其证券发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Includes 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1 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中存在流通受限情况的说明
报告期末,本基金按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 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中存在流通受限情况的说明
报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
单位:份

Table with 4 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额. Includes 5,016, 41,691.28, 49,579,409.85, 159,544,066.25.

8.2 期末上市基金前十名持有人
单位:份

Table with 4 columns: 序号, 持有人名称, 持有份额(份), 占上市总份额比例. Includes 1. UBS AG, 22,422,881.00, 25.53%.

8.3 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况
单位:份

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数(份), 占基金总份额比例. Includes 基金管理人所有从业人员持有本基金开放式基金, 848,107.41, 0.41%.

8.4 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况
单位:份

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数(份), 占基金总份额比例. Includes 基金合同生效日(2010年9月30日)基金份额总额, 1,016,880,356.49.

8.5 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况
单位:份

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数(份), 占基金总份额比例. Includes 基金合同生效日(2010年9月30日)基金份额总额, 1,016,880,356.49.

8.6 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况
单位:份

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数(份), 占基金总份额比例. Includes 基金合同生效日(2010年9月30日)基金份额总额, 1,016,880,356.49.

8.7 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况
单位:份

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数(份), 占基金总份额比例. Includes 基金合同生效日(2010年9月30日)基金份额总额, 1,016,880,356.49.

8.8 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况
单位:份

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数(份), 占基金总份额比例. Includes 基金合同生效日(2010年9月30日)基金份额总额, 1,016,880,356.49.

8.9 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况
单位:份

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数(份), 占基金总份额比例. Includes 基金合同生效日(2010年9月30日)基金份额总额, 1,016,880,356.49.

8.10 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况
单位:份

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数(份), 占基金总份额比例. Includes 基金合同生效日(2010年9月30日)基金份额总额, 1,016,880,356.49.

8.11 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况
单位:份

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数(份), 占基金总份额比例. Includes 基金合同生效日(2010年9月30日)基金份额总额, 1,016,880,356.49.