

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
重要提示
基金管理人的董事、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...

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)

2011年度报告摘要

4.6 管理人对于报告期内本基金估值程序等事项的说明
报告期末,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会颁布和修订的有关规定,日常估值由基金管理人估值系统与基金托管人估值系统双轮驱动...

7.4.1.2 债券交易
本期 2011年1月1日至2011年12月31日 及上年度可比期间 2010年9月30日(基金合同生效日)至2010年12月31日 1.本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。
7.4.1.3 债券回购交易
本期 2011年1月1日至2011年12月31日 及上年度可比期间 2010年9月30日(基金合同生效日)至2010年12月31日 1.本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。
7.4.1.4 基金交易
本期 2011年1月1日至2011年12月31日 及上年度可比期间 2010年9月30日(基金合同生效日)至2010年12月31日 1.本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。
7.4.1.5 权证交易
本期 2011年1月1日至2011年12月31日 及上年度可比期间 2010年9月30日(基金合同生效日)至2010年12月31日 1.本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。
7.4.1.6 应支付未支付的佣金
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 关联方名称, 2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年9月30日, 上年度可比期间. Rows include Deutsche Securities Asia Limited and 德意志证券亚洲有限公司.

2.2 基金产品说明
本基金进行主动性指数化投资,通过严格的投资纪律约束和量化的风险管理手段,力争取得本基金跟踪标的的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.5%,跟踪误差控制在1%以内,谋求对恒生中国企业指数的有效跟踪,力争取得与恒生中国企业指数相近的投资收益。

Table with 2 columns: 项目, 基金管理人/基金托管人. Rows include 名称, 信託服务, 客户服务, 传真, 2.4 境外资产托管人, 2.5 信息披露方式.

3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
3.1.1 主要财务指标
3.1.2 基金净值表现
3.1.3 基金业绩比较基准
注:①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额...

3.2 净值表现
3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比
3.2.2 基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比



图:嘉实恒指指数(QDII-LOF)基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

Table with 4 columns: 期间, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, 偏离度. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 自基金合同生效以来.

Table with 2 columns: 项目, 附注号. Rows include 资产, 银行存款, 其他金融资产, 交易性金融资产, 其中:股票投资, 基金投资, 股权投资, 资产支持证券投资, 衍生金融资产, 买入返售金融资产, 应收证券清算款, 应收股利, 应收利息, 其他资产, 资产总计, 负债, 短期借款, 应付证券清算款, 应付利息, 应付股利, 其他负债, 负债合计, 所有者权益, 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, 负债和所有者权益总计.

Table with 2 columns: 项目, 附注号. Rows include 一、收入, 利息收入, 其中:存款利息收入, 债券利息收入, 资产支持证券利息收入, 买入返售金融资产收入, 其他收入, 二、费用, 1.管理人报酬, 2.托管费, 3.销售服务费, 4.交易费用, 利息支出, 其中:卖出回购金融资产支出, 6.其他费用, 三、利润总额, 减:所得税费用, 四、净利润, 7.3 所有者权益-基金净值变动表

5.1 报告期末本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期,中国建设银行担任本基金的托管过程中,严格遵守了《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。

6.1 基金管理人对于报告期内本基金投资运作遵守信守、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、基金份额净值计算及基金收益分配等情况,进行了认真复核,对基金的投资运作进行了监督,未发现基金管理人存在违反法律法规和基金合同规定的行为,无损害基金份额持有人利益的行为。

7.1 资产负债表
资产负债表;嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)
报告截止日期:2011年12月31日
单位:人民币元

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末2011年12月31日, 上年度末2010年12月31日. Rows include 资产, 银行存款, 其他金融资产, 交易性金融资产, 其中:股票投资, 基金投资, 股权投资, 资产支持证券投资, 衍生金融资产, 买入返售金融资产, 应收证券清算款, 应收股利, 应收利息, 其他资产, 资产总计, 负债和所有者权益, 附注号, 本期末2011年12月31日, 上年度末2010年12月31日.

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期2011年1月1日至2011年12月31日, 上年度可比期间2010年9月30日至2010年12月31日. Rows include 一、收入, 利息收入, 其中:存款利息收入, 债券利息收入, 资产支持证券利息收入, 买入返售金融资产收入, 其他收入, 二、费用, 1.管理人报酬, 2.托管费, 3.销售服务费, 4.交易费用, 利息支出, 其中:卖出回购金融资产支出, 6.其他费用, 三、利润总额, 减:所得税费用, 四、净利润, 7.3 所有者权益-基金净值变动表

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期2011年1月1日至2011年12月31日, 上年度可比期间2010年9月30日至2010年12月31日. Rows include 一、期初所有者权益(基金净值), 本期公允价值变动损益(含金融资产公允价值变动和衍生金融资产公允价值变动), 本期损益(含公允价值变动、投资收益、其他收入-不含公允价值变动收益), 本期基金份额交易产生的基金份额变动(扣除申购费用和赎回款项), 本期基金申购款, 本期基金赎回款, 本期基金转换款, 本期基金转入款, 本期基金转出款, 本期基金分红, 本期基金其他变动, 期末所有者权益(基金净值)

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期2011年1月1日至2011年12月31日, 上年度可比期间2010年9月30日至2010年12月31日. Rows include 一、期初所有者权益(基金净值), 本期公允价值变动损益(含金融资产公允价值变动和衍生金融资产公允价值变动), 本期损益(含公允价值变动、投资收益、其他收入-不含公允价值变动收益), 本期基金份额交易产生的基金份额变动(扣除申购费用和赎回款项), 本期基金申购款, 本期基金赎回款, 本期基金转换款, 本期基金转入款, 本期基金转出款, 本期基金分红, 本期基金其他变动, 期末所有者权益(基金净值)

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期2011年1月1日至2011年12月31日, 上年度可比期间2010年9月30日至2010年12月31日. Rows include 一、期初所有者权益(基金净值), 本期公允价值变动损益(含金融资产公允价值变动和衍生金融资产公允价值变动), 本期损益(含公允价值变动、投资收益、其他收入-不含公允价值变动收益), 本期基金份额交易产生的基金份额变动(扣除申购费用和赎回款项), 本期基金申购款, 本期基金赎回款, 本期基金转换款, 本期基金转入款, 本期基金转出款, 本期基金分红, 本期基金其他变动, 期末所有者权益(基金净值)

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期2011年1月1日至2011年12月31日, 上年度可比期间2010年9月30日至2010年12月31日. Rows include 一、期初所有者权益(基金净值), 本期公允价值变动损益(含金融资产公允价值变动和衍生金融资产公允价值变动), 本期损益(含公允价值变动、投资收益、其他收入-不含公允价值变动收益), 本期基金份额交易产生的基金份额变动(扣除申购费用和赎回款项), 本期基金申购款, 本期基金赎回款, 本期基金转换款, 本期基金转入款, 本期基金转出款, 本期基金分红, 本期基金其他变动, 期末所有者权益(基金净值)

7.4.2 关联方投资
7.4.2.1 基金管理费
单位:人民币元
项目 | 2011年1月1日至2011年12月31日 | 2010年9月30日 | 上年度可比期间2010年9月30日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费 | 477,748.01 | - | 373,041.94
注:支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一交易日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累加至每月月底,按月支付,其计算公式为:日基金托管费=前一交易日基金资产净值*0.25%/当年天数。

Table with 4 columns: 项目, 本期2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年9月30日, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费, 当期发生的基金应支付的基金管理费, 其中:支付债券回购的资金净申购费.

7.4.2.2 基金托管费
单位:人民币元
项目 | 本期2011年1月1日至2011年12月31日 | 2010年9月30日 | 上年度可比期间2010年9月30日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费 | 477,748.01 | - | 373,041.94

Table with 4 columns: 项目, 本期2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年9月30日, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费, 当期发生的基金应支付的基金管理费, 其中:支付债券回购的资金净申购费.

7.4.2.3 基金业绩比较基准
嘉实恒指指数(QDII-LOF)的业绩比较基准为:恒生中国企业指数收益率乘以80%加上同期人民币活期存款利率乘以20%。
注:本基金在采取指数投资方法的基础上,根据对宏观经济、市场环境、市场估值、市场情绪等因素的综合判断,对基金投资组合进行适度的主动管理,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。

Table with 4 columns: 项目, 金额, 占基金资产净值的比例(%). Rows include 权益投资, 其中:普通股股票, 债券投资, 其中:国债, 资产支持证券投资, 衍生品投资, 基金合同生效以来权益投资, 其中:普通股股票, 债券投资, 资产支持证券投资, 衍生品投资.

Table with 4 columns: 项目, 金额, 占基金资产净值的比例(%). Rows include 权益投资, 其中:普通股股票, 债券投资, 其中:国债, 资产支持证券投资, 衍生品投资, 基金合同生效以来权益投资, 其中:普通股股票, 债券投资, 资产支持证券投资, 衍生品投资.

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计卖出金额, 金额单位:人民币元. Rows include Industrial and Commercial Bank of China, Bank of China Ltd., PetroChina Co., Ltd., etc.

8.5.3 权益投资的买入或本总额及卖出收入总额
买入成本-成交金额: 48,134,357.15
卖出收入-成交金额: 173,113,388.56
注:8.5.1项"买入金额"、8.5.2项"卖出金额"及8.5.3项"买入成本"、"卖出收入"均按买入或卖出成交金额成交价格和成交量孰低原则,不考虑相关交易费用。

Table with 4 columns: 项目, 本期2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年9月30日, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费, 当期发生的基金应支付的基金管理费, 其中:支付债券回购的资金净申购费.

Table with 4 columns: 项目, 本期2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年9月30日, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费, 当期发生的基金应支付的基金管理费, 其中:支付债券回购的资金净申购费.

Table with 4 columns: 项目, 本期2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年9月30日, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费, 当期发生的基金应支付的基金管理费, 其中:支付债券回购的资金净申购费.

Table with 4 columns: 项目, 本期2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年9月30日, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费, 当期发生的基金应支付的基金管理费, 其中:支付债券回购的资金净申购费.

Table with 4 columns: 项目, 本期2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年9月30日, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费, 当期发生的基金应支付的基金管理费, 其中:支付债券回购的资金净申购费.

Table with 4 columns: 项目, 本期2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年9月30日, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费, 当期发生的基金应支付的基金管理费, 其中:支付债券回购的资金净申购费.