

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:2013年8月26日

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本基金招募说明书中不存在虚假记载、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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年8月20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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要。

本半年度财务报表摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

Table with 2 columns: 2.1 基金基本情况, 2.2 基金产品说明. Includes details on fund name, type, and objectives.

Table with 2 columns: 2.3 基金管理人, 2.4 境外资产托管人. Lists management and custodian details.

Table with 2 columns: 2.5 信息披露方式, 2.6 主要财务指标和基金净值表现. Contains contact info and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 净值表现. Shows financial statements and performance trends.

Table with 2 columns: 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较. Compares fund performance to benchmarks.

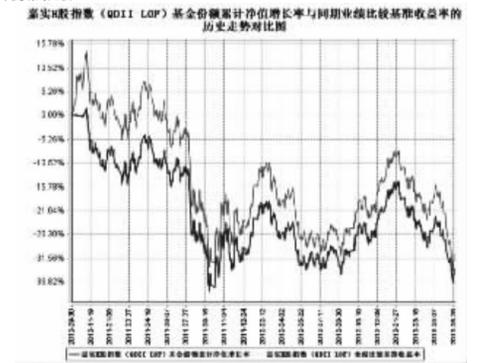


图:嘉实H指数(QDII-LOF)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:1.按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十四)(二)投资范围和(六)1.组合投资比例限制的有关约定。

注:2.2013年1月25日,本基金管理人发布《关于嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)基金管理人变更的公告》,张发民先生不再担任本基金基金经理,聘请杨阳先生担任本基金基金经理职务。

4.1 基金管理人及基金情况简介
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.1.2 基金管理人及其管理基金的经验

Table with 2 columns: 4.1.3 基金管理人及其管理基金的经验. Lists key personnel and their roles.

注:(1)基金经理张发民的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理杨阳的任职日期是指基金管理人作出决定后公告之日,离任日期指基金管理人作出决定后公告之日。

4.2 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规情况的说明
4.2.1 基金管理人严格遵守法律法规的情况

4.2.2 基金管理人严格遵守法律法规的情况
4.2.3 基金管理人严格遵守法律法规的情况

4.2.4 基金管理人严格遵守法律法规的情况
4.2.5 基金管理人严格遵守法律法规的情况

4.2.6 基金管理人严格遵守法律法规的情况
4.2.7 基金管理人严格遵守法律法规的情况

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
报告期内,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》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核,基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
(1)报告期内本基金未实施估值调整;
(2)根据本报告3.1.1“本报告期间”为15,574,038.01元,3.1.2“期末可供分配基金份额净值”为-0.3404元,3.1.3“期末基金份额净值”为0.6596元,以及本基金基金合同(十九(三)基金收益分配原则)“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,因此本基金报告期内未实施利润分配,符合基金合同约定。

5.1 报告期内本基金托管人履职情况说明
本报告期,中国建设银行股份有限公司在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、托管协议及其他有关规定,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守法律法规、基金合同、托管协议及其他有关规定的情况
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,对本基金的投资运作进行监督、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督和检查,未发现基金管理人投资行为有违反法律法规及基金合同、托管协议约定的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人复核审查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。

6.1 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:2013年6月30日

Table with 2 columns: 6.1 资产负债表. Shows assets and liabilities as of June 30, 2013.

6.2 利润表
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:2013年6月30日

Table with 2 columns: 6.2 利润表. Shows income statement items for the period.

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.6596元,基金份额总额112,750,446.03份。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

Table with 2 columns: 6.3 所有者权益(基金净值)变动表. Shows changes in net assets.

注:1.本报告期末基金份额净值0.6596元,基金份额总额112,750,446.03份。

7.1 期末基金资产组合情况
7.1.1 期末按行业分类的权益投资资产组合

Table with 2 columns: 7.1 期末基金资产组合情况. Shows portfolio composition by industry.

7.1.2 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资产组合

Table with 2 columns: 7.1.2 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资产组合

7.1.3 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资产组合

Table with 2 columns: 7.1.3 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资产组合

7.1.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资资产组合

Table with 2 columns: 7.1.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资资产组合

7.1.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资资产组合

Table with 2 columns: 7.1.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资资产组合

本期(2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012年6月30日),本基金未通过关联方交易进行债券投资。

6.4.1.1 债券回购
本期(2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012年6月30日),本基金未通过关联方交易进行债券回购。

6.4.1.2 基金交易
本期(2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012年6月30日),本基金未通过关联方交易进行基金交易。

6.4.1.3 权证交易
本期(2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012年6月30日),本基金未通过关联方交易进行权证交易。

6.4.1.4 应支付关联方的佣金
金额单位:人民币元

Table with 2 columns: 6.4.1.4 应支付关联方的佣金. Shows commission payments to related parties.

注:上述佣金按市场佣金率计算,该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.2 关联方费用
6.4.2.1 基金管理人
单位:人民币元

Table with 2 columns: 6.4.2.1 基金管理人. Shows fees paid to the fund manager.

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。

6.4.2.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with 2 columns: 6.4.2.2 基金托管费. Shows fees paid to the fund custodian.

注:支付基金管理人中国建设银行股份有限公司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。

6.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本期(2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012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 各关联方投资本基金的情况
6.4.4.1 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本期(2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012年6月30日),基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.2 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(2013年6月30日)及上年度可比期间(2012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 2 columns: 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

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

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本期(2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012年6月30日),本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名流通受限证券投资
6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本期(2013年6月30日),本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
本期(2013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 期末未上市流通的债券
6.4.5.3.1 银行间市场未上市债券
本期(2013年6月30日),本基金未持有银行间市场未上市债券。

6.4.5.3.2 交易所市场未上市债券
本期(2013年6月30日),本基金未持有交易所市场未上市债券。

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购余额
本期(2013年6月30日),本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.5.3.4 交易所市场债券逆回购余额
本期(2013年6月30日),本基金无交易所市场债券逆回购余额。

7.2 期末基金资产组合情况
7.2.1 期末按行业分类的权益投资资产组合

Table with 2 columns: 7.2.1 期末按行业分类的权益投资资产组合

7.2.2 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资产组合

Table with 2 columns: 7.2.2 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资产组合

7.2.3 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资产组合

Table with 2 columns: 7.2.3 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资产组合

Table with 2 columns: 7.2.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资资产组合

7.2.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资资产组合

Table with 2 columns: 7.2.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资资产组合

7.3 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: 7.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

买入成本(或卖入)总额
4,604,289.22
卖出收入(或买入)总额
17,588,553.88

注:3.5.1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(成交单价乘以成交数量)填列,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资产组合
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五名资产支持证券投资资产组合
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资产组合
报告期末,本基金未持有金融衍生品。

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基金投资资产组合
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受到公开谴责、处罚。

7.11.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.11.3 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.4 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.5 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.6 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.7 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.8 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.9 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.10 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.11 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.12 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.13 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.14 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.15 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.16 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.17 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.18 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.19 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.20 报告期内本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。