



# 信息披露

2013年10月24日 星期四  
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B196

## 嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)

### 2013 第三季度 报告

2013年9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:2013年10月24日**

**1.1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金增值。

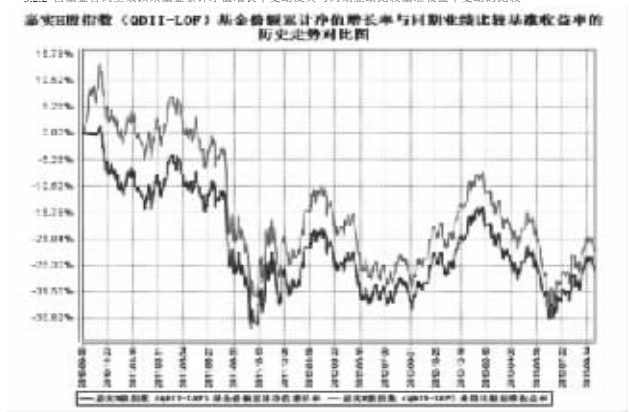
基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期内基金未发生诉讼。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

基金简称	嘉实恒生中国企业(QDII-LOF场内简称:恒生HBE)
基金代码	160717
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2010年9月30日
报告期末基金份额总额	105,441,959.08份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险控制手段,力争跟踪标的基金的净值增长率与标的指数收益率之间的日均跟踪偏离度不超过0.2%,跟踪误差不得超过4%,以实现恒生中国企业指数的有效跟踪,给投资者提供一个投资恒生中国企业指数的有效投资工具。
投资策略	本基金为被动式指数基金,按照成份股在恒生中国企业指数中的基准权重构建指数化投资组合。
业绩比较基准	人民币港币汇率*恒生中国企业指数
风险收益特征	较高风险、较高收益
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:Shanghai Street Bank and Trust Company

3.1 主要财务指标		单位:人民币元				
主要财务指标	报告期(2013年7月1日~2013年9月30日)					
1.本期已实现收益	-1,661,412.78					
2.本期利润	-7,377,639.40					
3.加权平均基金份额本期利润	0.0668					
4.期末基金资产净值	76,475,780.32					
5.期末基金份额净值	0.7253					
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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。						
3.2 本报告期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						
阶段	净值增长率 ①	净值增长率标准差 ②	业绩比较基准收益率 ③	业绩比较基准收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	9.96%	1.32%	10.28%	1.40%	-0.32%	-0.08%



注:本基金合同生效以来至本报告期末,本基金基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金合同生效以来至本报告期末,本基金基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
杨阳	基金经理	任职日期:2013年1月25日	13年	曾任贝莱德基金高级基金经理,2008年3月加入嘉实基金,负责嘉实恒生中国企业(QDII-LOF)基金的投资管理工作。

4.1 基金管理人(或基金经小组)简介

4.2 报告期内基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益,本基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.4 报告期内基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.5 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.6 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.7 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.8 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.9 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.10 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.11 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.12 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.13 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.14 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.15 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.16 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.17 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.18 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.19 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.20 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.21 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.22 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.23 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.24 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.25 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.26 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.27 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.28 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.29 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.30 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.31 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.32 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.33 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.34 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.35 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.36 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.37 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.38 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.39 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.40 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.41 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.42 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.43 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.44 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.45 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.46 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.47 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.48 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.49 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.50 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.51 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.52 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.53 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.54 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.55 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.56 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.57 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.58 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.59 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.60 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.61 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.62 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.63 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.64 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.65 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.66 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.67 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.68 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.69 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.70 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.71 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.72 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.73 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.74 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.75 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.76 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.77 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.78 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.79 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.80 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.81 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.82 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.83 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.84 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.85 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.86 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.87 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.88 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.89 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.90 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.91 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.92 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.93 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.94 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.95 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.96 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.97 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.98 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.99 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.100 基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的约定,认真履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	70,651,530.16	91.09
	其中:普通股	70,651,530.16	91.09
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-

**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:2013年10月24日**

**1.1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金增值。

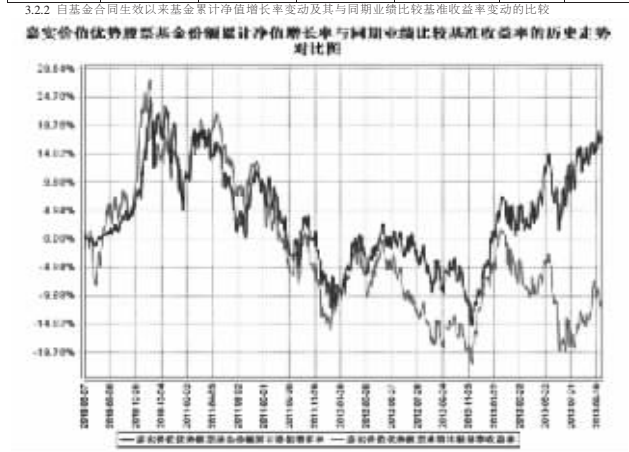
基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期内基金未发生诉讼。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

基金简称	嘉实价值优势股票
基金代码	070019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月7日
报告期末基金份额总额	2,310,155,182.98份
投资目标	运用价值投资方法,精选在基本面具备核心竞争力、且市场估值水平具备性价比的优质股票,并长期持有,分享其长期增值收益。
投资策略	本基金以价值投资理念为核心,根据中国股票市场的投资特点进行改良应用,并依据不同的经济环境对市场进行细分,选择具有长期竞争优势、估值合理以及行业前景良好的个股进行投资,并依据国内外的市场环境和个股的具体情况,综合考虑估值、成长性、行业前景以及市场流动性等因素,发现具有投资价值的个股。
业绩比较基准	沪深300指数*95%+上证国债指数*5%
风险收益特征	较高风险、较高收益
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

主要财务指标		报告期(2013年7月1日~2013年9月30日)		单位:人民币元		
1.本期已实现收益				204,165,785.45		
2.本期利润				334,573,391.01		
3.加权平均基金份额本期利润				0.1327		
4.期末基金资产净值				2,646,565,914.68		
5.期末基金份额净值				1.146		
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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。						
3.2 基金净值表现						
3.2.1 本报告期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						
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.02%	1.19%	9.03%	1.36%	3.99%	-0.17%



4	金融行业生产投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入回购/融券卖出	-	-
	其中:买入回购/融券卖出	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,737,533.91	8.69
8	其他资产	176,256.06	0.23
合计	77,565,320.13	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	70,651,530.16	92.38
合计	70,651,530.16	92.38
5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合		
5.3.1 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合		
行业类别	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
非必需消费品	2,897,099.41	3.79
必需消费品	654,910.62	0.86
能源	14,699,930.33	19.22
金融	43,360,919.37	56.70
医疗保健	1,002,777.58	1.31
工业	2,400,823.04	3.14
信息技术	-	-
原材料	2,569,072.23	3.36
电信服务	1,640,416.32	2.15
公用事业	1,425,580.26	1.86
合计	70,651,530.16	92.38

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 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合								
报告期末,本基金未持有股票及存托凭证投资组合								
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明细								
5.4.1 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明细								
序号	公司简称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	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	Bank of China Ltd	中国银行	3988.HK	香港证券交易所	中国香港	2,607,000	7,317,222.80	9.57
2	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	工商银行	1398.HK	香港证券交易所	中国香港	1,670,000	7,163,342.59	9.37
3	PetroChina Co., Ltd.	中国石油股份	857.HK	香港证券交易所	中国香港	816,000	5,538,165.24	7.24
4	Bank of Communications Co., Ltd.	交通银行	3328.HK	香港证券交易所	中国香港	1,116,400	5,045,412.39	6.60
5	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	386.HK	香港证券交易所	中国香港	985,600	4,743,417.72	6.20
6	China Life Insurance Co., Ltd.	中国人寿	2628.HK	香港证券交易所	中国香港	288,000	4,589,765.86	6.00
7	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd.	中国平安	2318.HK	香港证券交易所	中国香港	79,000	3,611,007.48	4.72
8	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行	3968.HK	香港证券交易所	中国香港	301,350	3,368,932.38	4.41
9	China CITIC Bank Corporation Ltd.	中信银行	998.HK	香港证券交易所	中国香港	968,000	3,085,342.60	4.03
10	Agricultural Bank of China Ltd.	农业银行	1288.HK	香港证券交易所	中国香港	891,000	2,522,016.40	3.30

(1)报告期内本基金基金合同约定,本基金为被动式指数基金,投资组合中股票投资及基金投资比例不低于基金资产的90%。(2)本报告使用的证券代码为彭博代码。

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明细

报告期末,本基金未持有股票及存托凭证投资组合

5.5 报告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。

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明细

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。

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明细

报告期末,本基金未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

报告期末,本基金未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

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

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	171,822.01
4	应收股利	475.60
5	应收申购款	3,958.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	合计	176,256.06

5.10.4 报告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。	
5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明	
报告期末,本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明。	
5.10.6 报告期末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。	
5.10.7 报告期末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。	
5.10.8 报告期末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。	
5.10.9 报告期末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。	
5.10.10 报告期末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。	
5.10.11 报告期末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。	
5.10.12 报告期末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。	
5.10.13 报告期末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。	
5.10.14 报告期末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。	
5.10.15 报告期末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。	
5.10.16 报告期末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。	
5.10.17 报告期末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。	
5.10.18 报告期末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。	
5.10.19 报告期末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。	
5.10.20 报告期末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。	
5.10.21 报告期末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。	
5.10.22 报告期末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。	
5.10.23 报告期末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。	
5.10.24 报告期末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。	
5.10.25 报告期末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。	
5.10.26 报告期末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。	
5.10.27 报告期末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。	
5.10.28 报告期末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。	
5.10.29 报告期末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。	
5.10.30 报告期末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。	
5.10.31 报告期末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。	
5.10.32 报告期末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。	
5.10.33 报告期末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。	
5.10.34 报告期末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。	
5.10.35 报告期末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。	
5.10.36 报告期末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。	
5.10.37 报告期末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。	
5.10.38 报告期末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。	
5.10.39 报告期末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。	
5.10.40 报告期末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。	
5.10.41 报告期末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。	
5.10.42 报告期末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。	
5.10.43 报告期末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。	
5.10.44 报告期末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。	
5.10.45 报告期末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。	
5.10.46 报告期末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。	
5.10.47 报告期末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。	
5.10.48 报告期末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。	
5.10.49 报告期末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。	
5.10.50 报告期末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。	
5.10.51 报告期末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。	
5.10.52 报告期末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。	
5.10.53 报告期末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。	
5.10.54 报告期末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。	
5.10.55 报告期末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。	
5.10.56 报告期末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。	
5.10.57 报告期末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。	
5.10.58 报告期末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。	
5.10.59 报告期末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。	
5.10.60 报告期末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。	
5.10.61 报告期末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。	
5.10.62 报告期末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。	
5.10.63 报告期末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。	
5.10.64 报告期末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。	
5.10.65 报告期末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。	
5.10.66 报告期末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。	
5.10.67 报告期末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。	
5.10.68 报告期末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。	
5.10.69 报告期末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。	
5.10.70 报告期末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。	
5.10.71 报告期末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。	
5.10.72 报告期末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。	
5.10.73 报告期末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。	
5.10.74 报告期末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。	
5.10.75 报告期末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。	
5.10.76 报告期末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。	
5.10.77 报告期末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。	
5.10.78 报告期末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。	
5.10.79 报告期末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。	
5.10.80 报告期末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。	
5.10.81 报告期末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。	
5.10.82 报告期末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。	
5.10.83 报告期末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。	
5.10.84 报告期末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。	
5.10.85 报告期末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。	
5.10.86 报告期末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。	
5.10.87 报告期末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。	
5.10.88 报告期末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。	
5.10.89 报告期末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。	
5.10.90 报告期末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。	
5.10.91 报告期末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。	
5.10.92 报告期末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。	
5.10.93 报告期末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。	
5.10.94 报告期末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。	
5.10.95 报告期末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。	
5.10.96 报告期末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。	
5.10.97 报告期末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。	
5.10.98 报告期末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。	
5.10.99 报告期末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。	
5.10.100 报告期末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。	

<b>§ 6 开放式基金份额变动</b>		单位:份
报告期初的基金份额总额	112,750,446.03	
报告期内基金份额总额	2,179,763.10	
期末,报告期内基金份额总额	9,488,255.03	
报告期间基金拆分变动份额	-	
报告期末基金份额总额	105,441,959.08	