

## 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:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:2013年9月24日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别责任。

基金托管人对本报告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金合同由基金管理人和基金托管人根据法律法规及基金合同的约定，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页，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金由基金管理人代表基金份额持有人利益，按照基金合同的约定，对基金资产进行运作。

基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。

本报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	嘉实恒生指数(QDII-LOF)(场内简称:恒生H股)
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	105,441,959.00份

本基金通过指数化投资，通过严格的投票给定的规则和数量化的风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不超过0.3%，年跟踪误差不超过1.4%，以实现对恒生中国企业指数的有效投资。

本基金通过买卖代表恒生中国企业指数成份股和恒生中国企业成份股，从而实现对恒生中国企业指数的有效投资。

本报告期中财务数据未经审计。

## §3 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.期末基金份额净值	76,475,780.32
5.期末基金份额总额	105,441,959.00

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，本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)所对应的应付未付款项，计入费用时采用摊余成本法；(2)所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用时采用摊余成本法。

3.2 基金的基本信息

3.2.1 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:嘉实恒生指数(QDII-LOF)基金份额净值增长率为每只定期开放周期结束后的最近一个工作日的单位净值减去前一个定期开放周期开始时的单位净值，期间业绩比较基准收益率变动为期间内定期开放周期的业绩比较基准收益率的平均数。

3.4 管理人报告

3.4.1 公司基本情况

报告期内，基金管理人严格按照《基金法》、《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定，遵循诚实信用、勤勉尽责的原则，履行基金合同和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

3.4.2 基金销售情况

报告期内，本基金未发生异常销售行为。

3.4.3 公司年度报告说明

4.1 本期定期报告披露情况说明

本基金期内定期报告披露情况说明

本基金期内，基金业绩指标均误差不超过0.1%，年化回报率偏离度在1.8%左右，符合基金合同约定的日跟踪误差不超过0.3%的限制，本基金跟踪误差主要是由于限制投资股票的替代选择、股票组合最高仓位限制、人民币汇率的汇率变化以及申购赎回等因素所致。

4.2 报告期内基金运作揭示

报告期内，基金管理人严格按照《基金法》、《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定，遵循诚实信用、勤勉尽责的原则，履行基金合同和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公司公平交易制度的情况说明

4.4 公司异常交易行为的专项说明

4.5 管理人对报告期内基金运作揭示的说明

5.1 本期定期报告披露情况说明

5.2 本期定期报告披露情况说明

5.3 本期定期报告披露情况说明

5.4 本期定期报告披露情况说明

5.5 本期定期报告披露情况说明

5.6 本期定期报告披露情况说明

5.7 本期定期报告披露情况说明

5.8 本期定期报告披露情况说明

5.9 本期定期报告披露情况说明

5.10 投资组合类公告

5.11 基金净值表现

5.12 基金份额净值

5.13 基金资产净值

5.14 基金资产总值

5.15 基金负债

5.16 基金资产净值

5.17 基金资产总值

5.18 基金负债

5.19 基金资产净值

5.20 基金资产总值

5.21 基金负债

5.22 基金资产净值

5.23 基金资产总值

5.24 基金负债

5.25 基金资产净值

5.26 基金资产总值

5.27 基金负债

5.28 基金资产净值

5.29 基金资产总值

5.30 基金负债

5.31 基金资产净值

5.32 基金资产总值

5.33 基金负债

5.34 基金资产净值

5.35 基金资产总值

5.36 基金负债

5.37 基金资产净值

5.38 基金资产总值

5.39 基金负债

5.40 基金资产净值

5.41 基金资产总值

5.42 基金负债

5.43 基金资产净值

5.44 基金资产总值

5.45 基金负债

5.46 基金资产净值

5.47 基金资产总值

5.48 基金负债

5.49 基金资产净值

5.50 基金资产总值

5.51 基金负债

5.52 基金资产净值

5.53 基金资产总值

5.54 基金负债

5.55 基金资产净值

5.56 基金资产总值

5.57 基金负债

5.58 基金资产净值

5.59 基金资产总值

5.60 基金负债

5.61 基金资产净值

5.62 基金资产总值

5.63 基金负债

5.64 基金资产净值

5.65 基金资产总值

5.66 基金负债

5.67 基金资产净值

5.68 基金资产总值

5.69 基金负债

5.70 基金资产净值

5.71 基金资产总值

5.72 基金负债

5.73 基金资产净值

5.74 基金资产总值

5.75 基金负债

5.76 基金资产净值

5.77 基金资产总值

5.78 基金负债

5.79 基金资产净值

5.80 基金资产总值

5.81 基金负债

5.82 基金资产净值

5.83 基金资产总值

5.84 基金负债

5.85 基金资产净值

5.86 基金资产总值

5.87 基金负债

5.88 基金资产净值

5.89 基金资产总值

5.90 基金负债

5.91 基金资产净值

5.92 基金资产总值

5.93 基金负债

5.94 基金资产净值

5.95 基金资产总值

5.96 基金负债

5.97 基金资产净值

5.98 基金资产总值

5.99 基金负债

5.10 基金资产净值

5.11 基金资产总值

5.12 基金负债

5.13 基金资产净值

5.14 基金资产总值

5.15 基金负债

5.16 基金资产净值

5.17