

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)

2014 第二季度 报告

2014年6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:2014年7月19日

重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在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...

基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (嘉实恒生中国企业指数(QDII-LOF)场内申购(恒指)) and 基金代码 (160707). Includes details on investment objectives, strategies, and management.

主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期 (2014年4月1日至2014年6月30日). Shows metrics like net income, expenses, and net assets.

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...

基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为恒生中国企业指数收益率。本基金投资于恒生中国企业指数的资产不低于基金资产净值的90%...

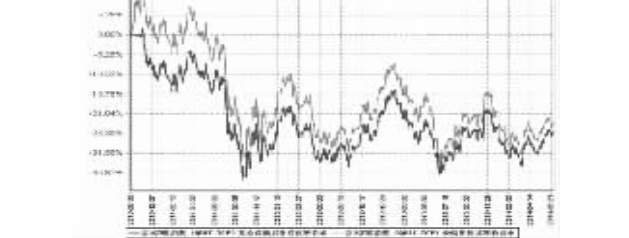


图:嘉实恒生中国企业指数(QDII-LOF)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:按基金合同约定,本基金自2014年5月26日起,在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)、组合投资比例限制的有关约定。

基金管理人

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的起始日期, 证券从业年限. Lists key management personnel including the fund manager and compliance officer.

注:(1)任职日期、离任日期是指公告确定的公告之日;(2)证券从业年限是指从事与基金行业相关业务(证券从业资格)的相关年限。

基金投资组合报告

截至2014年6月30日,本基金资产组合情况如下: 本基金投资于恒生中国企业指数的资产不低于基金资产净值的90%...

基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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:2014年7月19日

重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在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...

基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (嘉实沪深300ETF) and 基金代码 (159919). Includes details on investment objectives, strategies, and management.

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期 (2014年4月1日至2014年6月30日). Shows metrics like net income, expenses, and net assets.

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...

基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率。本基金投资于沪深300指数的资产不低于基金资产净值的90%...

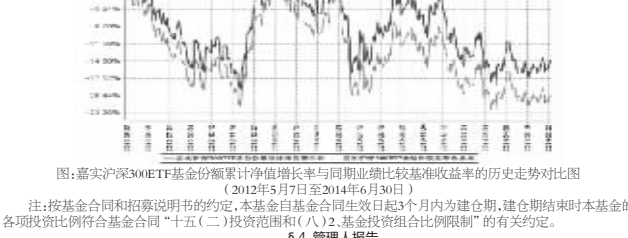


图:嘉实沪深300ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:按基金合同约定,本基金自2014年4月16日起,在建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十五)二)投资范围和(八)二)投资组合比例限制的有关约定。

基金管理人

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的起始日期, 证券从业年限. Lists key management personnel including the fund manager and compliance officer.

注:(1)任职日期、离任日期是指公告确定的公告之日;(2)证券从业年限是指从事与基金行业相关业务(证券从业资格)的相关年限。

基金投资组合报告

截至2014年6月30日,本基金资产组合情况如下: 本基金投资于沪深300指数的资产不低于基金资产净值的90%...

基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

基金资产净值

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值的比例(%). Shows the breakdown of net assets into equity, bonds, and other categories.

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Shows the industry breakdown of the fund's equity investments.

5.3 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投资明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 10 stocks held by the fund.

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五名债券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 bonds held by the fund.

5.5 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权证投资明细

Table with 4 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 warrants held by the fund.

5.6 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

5.7 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.8 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

5.9 报告期末本基金投资的贵金属投资情况说明

5.10 报告期末本基金投资的衍生品投资情况说明

5.11 投资组合报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.12 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.13 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.14 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.15 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.16 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.17 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.18 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.19 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.20 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.21 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.22 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.23 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.24 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.25 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.26 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.27 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.28 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.29 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.30 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.31 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.32 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.33 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.34 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.35 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.36 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.37 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.38 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.39 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.40 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.41 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.42 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.43 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.44 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.45 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.46 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.47 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.48 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.49 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.50 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.51 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.52 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.53 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.54 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.55 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.56 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.57 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.58 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.59 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.60 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.61 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.62 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.63 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.64 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.65 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.66 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.67 报告期末基金资产净值及基金份额净值

5.68 报告期末基金资产净值及基金份额净值

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:2014年7月19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:2014年7月19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:2014年7月19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:2014年7月19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:2014年7月19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:2014年7月19日