

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:2014年08月25日

重要提示
基金管理人的董事会、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法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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,基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,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及更新。

本半年度报告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,本报告中财务资料未经审计。

本报告自2014年1月1日起至2014年6月30日止。
2.1 基金基本情况
基金名称:嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)

Table with 2 columns: Item and Value. Includes details like fund name, type, code, and manager information.

Table with 2 columns: Item and Value. Includes details about the fund's investment objectives, strategies, and risk characteristics.

Table with 2 columns: Item and Value. Includes details about the fund's management and trustees.

Table with 2 columns: Item and Value. Includes details about the fund's website and contact information.

6.3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标

Table with 2 columns: Item and Value. Shows financial metrics for the period from 2014-01-01 to 2014-06-30.

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)所述基金净值指标不包括持有人认购及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)期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰孰数。

3.2 基金净值表现
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

Table with 2 columns: Period and Value. Compares fund performance against benchmarks over different periods.

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

6.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理简介
4.1.1 基金管理人基本情况
4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

Table with 2 columns: Name and Information. Lists fund managers and their qualifications.

注:(1)任职日期、离任日期是指公司作出决定后之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其各项法律法规、《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》及其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,严格执行投资管理流程和授权机制,并在获得投资信息、投资决策和风险控制决策方面享有公平的机会,通过交易公平交易范围内各交易员的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易制度的落实,通过交易系统自动人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易,同日反向交易或较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%,合计3次,均为旗下ETF被动跟踪标的指数的需要和其他组合发生反向交易,但不存在利益输送行为。

4.4 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明
截至报告期末,本基金日均跟踪误差为0.14%,年化综合偏离度为2.19%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不得超过0.3%的限制。

本基金跟踪误差主要源自跟踪投资股票的替代选择、股票组合高低仓位限制、人民币港币的汇率变化以及申购赎回的冲击。

4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末基金净值为0.7404元;本报告基金份额净值增长率为-1.54%,业绩比较基准收益率为-3.87%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
本基金作为一只投资于香港恒生指数的被动投资管理产品,我们将继续秉承被动化被动投资策略,积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,力争进一步降低本基金的跟踪误差,给投资者提供一个

2014 半年度 报告摘要

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)

2014年6月30日
注:本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.1.1 债券交易
本期(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.1.2 债券回购交易
本期(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.1.3 基金交易
本期(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.1.4 权证交易
本期(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.1.5 支付关联方款项
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行支付关联方款项。

6.4.1.6 关联方证券出借
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借。

6.4.1.7 关联方证券借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券借入。

6.4.1.8 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.9 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.10 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.11 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.12 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.13 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.14 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.15 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.16 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.17 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.18 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.19 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.20 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.21 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.22 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.23 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.24 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.25 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.26 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.27 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.28 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.29 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.30 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.31 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.32 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.33 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.34 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.35 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.36 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.37 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.38 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.39 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.40 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.41 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.42 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.43 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.44 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.45 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.46 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.47 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.48 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.49 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.50 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.51 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.52 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.53 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.54 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.55 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.56 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.57 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.58 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.59 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.60 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.61 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.62 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

6.4.1.63 关联方证券出借和借入
本期(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行证券出借和借入。

注:报告期内,本基金累计买入金额前20名的权益投资(包括上述12只股票投资)。

7.5.2 累计卖出金额前20名的权益投资明细
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: Rank, Company Name, Code, Buy Amount, Sell Amount. Lists top 20 securities bought and sold.

7.5.3 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: Item and Amount. Shows total purchase and sale amounts for equity investments.

注:7.5.1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。

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明细
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明细
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受监管部门立案调查,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。

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

7.11.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

Table with 2 columns: Item and Amount. Lists other assets at the end of the period.

7.11.4 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。

7.11.5 期末持有的处于转股期可转换债券明细
报告期末,本基金未持有处于转股期可转换债券。

7.11.6 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末,本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.7 期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末,本基金未持有指数投资股票。

8 基金份额持有人信息
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
单位:份

Table with 2 columns: Item and Value. Shows number of shareholders and their structure.

8.2 期末上市基金前十名持有人
单位:份

Table with 2 columns: Rank and Name. Lists top 10 shareholders of the listed fund.

注:上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
单位:份

Table with 2 columns: Item and Value. Shows fund manager's holdings.

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金基金份额区间的情况
单位:份

Table with 2 columns: Item and Value. Shows fund manager's holdings in the open-ended fund.

8.5 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: Item and Value. Shows changes in open-ended fund shares.

8.6 重大事件揭示
10.1 基金份额持有人大会决议
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.3 涉及基金管理人、基金托管人、基金托管业务的诉讼
10.4 基金投资策略的改变

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
金额单位:人民币元

Table with 2 columns: Item and Value. Shows details of securities transaction units.

注:基金管理人根据研究报告、交易所、销售服务、投资策略服务、市场及后台服务等评价指标选择交易券商,并选择签署的交易券商服务协议,通知基金托管人,严格遵照监管规定和经纪商签订的协议,按照市场惯例确定并执行。

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话400-600-8800,或发电子邮件: E-mail:service@fund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2014年8月25日