

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF)

2013年度报告摘要

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)
基金简称: 嘉实恒生指数(QDII-LOF)(场内简称: 恒生H)

2.2 基金产品说明
本基金为被动式指数基金, 通过严格的资产投资组合和数量化的风险管理手段, 力争使本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差小于0.3%, 跟踪误差不得超过0.5%。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 境外资产托管人
名称: State Street Bank and Trust Company
办公地址: 美国马萨诸塞州波士顿银行一号

2.5 信息披露方式
本基金年度报告全文的管理人互联网网址: http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点: 北京市建国门内大街1号嘉实基金管理有限公司

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 4 columns: 项目, 2013年末, 2012年末, 2011年末. Rows include 1.1 期末资产总额, 1.2 期末负债总额, 1.3 期末净资产总额, etc.

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。

3.2 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
阶段 份额净值增长率 业绩比较基准收益率 差额

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
图: 嘉实恒生指数(QDII-LOF)基金份额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. 本基金合同生效日为2010年9月30日, 2010年度的相关数据按照当年实际存续期间(2010年9月30日至2010年12月31日)计算。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金托管人
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

4.2 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.1 基金投资组合报告
期末资产总额: 129,712,717.24
期末负债总额: 25,938,692.82

4.2.2 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.3 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.4 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.5 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.6 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.7 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.8 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.9 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.10 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.11 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.12 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.13 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.14 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.15 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.16 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.17 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.18 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.19 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.20 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.21 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.22 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.23 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.24 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.25 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.26 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.27 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.28 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.29 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.30 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.31 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.32 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.33 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.34 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.35 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.36 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.37 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.38 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.39 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.40 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.41 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.42 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.43 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.44 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.45 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.46 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.47 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.48 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.49 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

4.2.50 基金业绩
基金业绩(或基金经理小组)及基金投资组合报告

基金信息

7.4.4.2 关联方报告
7.4.4.2.1 基金管理人
7.4.4.2.2 基金托管人

7.4.4.2.3 基金销售机构
7.4.4.2.4 基金服务机构

7.4.4.2.5 基金投资顾问
7.4.4.2.6 基金外包机构

7.4.4.2.7 基金其他关联方
7.4.4.2.8 基金其他关联方

7.4.4.2.9 基金其他关联方
7.4.4.2.10 基金其他关联方

7.4.4.2.11 基金其他关联方
7.4.4.2.12 基金其他关联方

7.4.4.2.13 基金其他关联方
7.4.4.2.14 基金其他关联方

7.4.4.2.15 基金其他关联方
7.4.4.2.16 基金其他关联方

7.4.4.2.17 基金其他关联方
7.4.4.2.18 基金其他关联方

7.4.4.2.19 基金其他关联方
7.4.4.2.20 基金其他关联方

7.4.4.2.21 基金其他关联方
7.4.4.2.22 基金其他关联方

7.4.4.2.23 基金其他关联方
7.4.4.2.24 基金其他关联方

7.4.4.2.25 基金其他关联方
7.4.4.2.26 基金其他关联方

7.4.4.2.27 基金其他关联方
7.4.4.2.28 基金其他关联方

7.4.4.2.29 基金其他关联方
7.4.4.2.30 基金其他关联方

7.4.4.2.31 基金其他关联方
7.4.4.2.32 基金其他关联方

7.4.4.2.33 基金其他关联方
7.4.4.2.34 基金其他关联方

7.4.4.2.35 基金其他关联方
7.4.4.2.36 基金其他关联方

7.4.4.2.37 基金其他关联方
7.4.4.2.38 基金其他关联方

7.4.4.2.39 基金其他关联方
7.4.4.2.40 基金其他关联方

7.4.4.2.41 基金其他关联方
7.4.4.2.42 基金其他关联方

7.4.4.2.43 基金其他关联方
7.4.4.2.44 基金其他关联方

7.4.4.2.45 基金其他关联方
7.4.4.2.46 基金其他关联方

7.4.4.2.47 基金其他关联方
7.4.4.2.48 基金其他关联方

7.4.4.2.49 基金其他关联方
7.4.4.2.50 基金其他关联方

7.4.4.2.51 基金其他关联方
7.4.4.2.52 基金其他关联方

7.4.4.2.53 基金其他关联方
7.4.4.2.54 基金其他关联方

7.4.4.2.55 基金其他关联方
7.4.4.2.56 基金其他关联方

7.4.4.2.57 基金其他关联方
7.4.4.2.58 基金其他关联方

7.4.4.2.59 基金其他关联方
7.4.4.2.60 基金其他关联方

7.4.4.2.61 基金其他关联方
7.4.4.2.62 基金其他关联方

7.4.4.2.63 基金其他关联方
7.4.4.2.64 基金其他关联方

7.4.4.2.65 基金其他关联方
7.4.4.2.66 基金其他关联方

7.4.4.2.67 基金其他关联方
7.4.4.2.68 基金其他关联方

7.4.4.2.69 基金其他关联方
7.4.4.2.70 基金其他关联方

7.4.4.2.71 基金其他关联方
7.4.4.2.72 基金其他关联方

7.4.4.2.73 基金其他关联方
7.4.4.2.74 基金其他关联方

7.4.4.2.75 基金其他关联方
7.4.4.2.76 基金其他关联方

7.4.4.2.77 基金其他关联方
7.4.4.2.78 基金其他关联方

7.4.4.2.79 基金其他关联方
7.4.4.2.80 基金其他关联方

7.4.4.2.81 基金其他关联方
7.4.4.2.82 基金其他关联方

7.4.4.2.83 基金其他关联方
7.4.4.2.84 基金其他关联方

7.4.4.2.85 基金其他关联方
7.4.4.2.86 基金其他关联方

7.4.4.2.87 基金其他关联方
7.4.4.2.88 基金其他关联方

7.4.4.2.89 基金其他关联方
7.4.4.2.90 基金其他关联方

7.4.4.2.91 基金其他关联方
7.4.4.2.92 基金其他关联方

7.4.4.2.93 基金其他关联方
7.4.4.2.94 基金其他关联方

7.4.4.2.95 基金其他关联方
7.4.4.2.96 基金其他关联方

7.4.4.2.97 基金其他关联方
7.4.4.2.98 基金其他关联方

7.4.4.2.99 基金其他关联方
7.4.4.2.100 基金其他关联方

7.4.4.2.101 基金其他关联方
7.4.4.2.102 基金其他关联方

7.4.4.2.103 基金其他关联方
7.4.4.2.104 基金其他关联方

7.4.4.2.105 基金其他关联方
7.4.4.2.106 基金其他关联方

7.4.4.2.107 基金其他关联方
7.4.4.2.108 基金其他关联方

7.4.4.2.109 基金其他关联方
7.4.4.2.110 基金其他关联方

7.4.4.2.111 基金其他关联方
7.4.4.2.112 基金其他关联方

7.4.4.2.113 基金其他关联方
7.4.4.2.114 基金其他关联方

7.4.4.2.115 基金其他关联方
7.4.4.2.116 基金其他关联方

7.4.4.2.117 基金其他关联方
7.4.4.2.118 基金其他关联方

7.4.4.2.119 基金其他关联方
7.4.4.2.120 基金其他关联方

7.4.4.2.121 基金其他关联方
7.4.4.2.122 基金其他关联方

7.4.4.2.123 基金其他关联方
7.4.4.2.124 基金其他关联方

7.4.4.2.125 基金其他关联方
7.4.4.2.126 基金其他关联方

7.4.4.2.127 基金其他关联方
7.4.4.2.128 基金其他关联方

7.4.4.2.129 基金其他关联方
7.4.4.2.130 基金其他关联方

7.4.4.2.131 基金其他关联方
7.4.4.2.132 基金其他关联方

7.4.4.2.133 基金其他关联方
7.4.4.2.134 基金其他关联方

7.4.4.2.135 基金其他关联方
7.4.4.2.136 基金其他关联方

7.4.4.2.137 基金其他关联方
7.4.4.2.138 基金其他关联方

7.4.4.2.139 基金其他关联方
7.4.4.2.140 基金其他关联方

7.4.4.2.141 基金其他关联方
7.4.4.2.142 基金其他关联方

7.4.4.2.143 基金其他关联方
7.4.4.2.144 基金其他关联方

7.4.4.2.145 基金其他关联方
7.4.4.2.146 基金其他关联方

7.4.4.2.147 基金其他关联方
7.4.4.2.148 基金其他关联方

7.4.4.2.149 基金其他关联方
7.4.4.2.150 基金其他关联方

7.4.4.2.151 基金其他关联方
7.4.4.2.152 基金其他关联方

7.4.4.2.153 基金其他关联方
7.4.4.2.154 基金其他关联方

7.4.4.2.155 基金其他关联方
7.4.4.2.156 基金其他关联方

7.4.4.2.157 基金其他关联方
7.4.4.2.158 基金其他关联方

7.4.4.2.159 基金其他关联方
7.4.4.2.160 基金其他关联方

7.4.4.2.161 基金其他关联方
7.4.4.2.162 基金其他关联方

7.4.4.2.163 基金其他关联方
7.4.4.2.164 基金其他关联方

7.4.4.2.165 基金其他关联方
7.4.4.2.166 基金其他关联方

7.4.4.2.167 基金其他关联方
7.4.4.2.168 基金其他关联方

7.4.4.2.169 基金其他关联方
7.4.4.2.170 基金其他关联方

7.4.4.2.171 基金其他关联方
7.4.4.2.172 基金其他关联方

7.4.4.2.173 基金其他关联方
7.4.4.2.174 基金其他关联方

7.4.4.2.175 基金其他关联方
7.4.4.2.176 基金其他关联方

8.5.2 累计卖出金额前20名的权益投资明细

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

Table with 2 columns: 买入成本(或支出)总额, 卖出收入(或支出)总额

注: 1. 买入成本(或支出)总额包含“买入基金”及“买入股票”两部分, “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。

8.6 期末按市值占基金净资产比例大小排序的前十名股票投资明细

8.7 期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前十名债券投资明细

8.8 期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前十名金融衍生品投资明细

8.9 期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前十名贵金属投资明细

8.10 期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前十名基金投资明细

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.11.5 期末持有的处于转股期的可转换债券

8.11.6 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.7 期末前十名债券中存在流通受限情况的说明

8.11.8 期末贵金属投资前五名贵金属中不存在流通受限情况的说明

8.11.9 期末其他投资前五名其他投资中不存在流通受限情况的说明

8.11.10 其他资产构成

8.11.11 投资组合报告附注

8.11.12 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。

8.11.13 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。

8.11.14 期末其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额

8.11.15 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.11.16 期末持有的处于转股期的可转换债券

8.11.17 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.18 期末前十名债券中存在流通受限情况的说明

8.11.19 期末贵金属投资前五名贵金属中不存在流通受限情况的说明

8.11.20 期末其他投资前五名其他投资中不存在流通受限情况的说明

8.11.21 其他资产构成

8.11.22 投资组合报告附注

8.11.23 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。

8.11.24 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。

8.11.25 期末其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额

8.11.26 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.11.27 期末持有的处于转股期的可转换债券

8.11.28 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.29 期末前十名债券中存在流通受限情况的说明

8.11.30 期末贵金属投资前五名贵金属中不存在流通受限情况的说明

8.11.31 期末其他投资前五名其他投资中不存在流通受限情况的说明

8.11.32 其他资产构成

8.11.33 投资组合报告附注

8.11.34 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。

8.11.35 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。

8.11.36 期末其他各项资产构成