嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）

【2014】半年度报告摘要

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8月25日

§1 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的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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其更新。

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。

本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金简介

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H股指数（QDII-LOF）
场内简称	恒生H股
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	90,407,907.23份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010-10-28

2.2 基金产品说明

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管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.3%，年跟踪误差不超过4%，以实现对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	本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	田青
	联系电话	(010)65215588	(010)67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	(010)67595096
传真		(010)65182266	(010)66275853

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	State Street Bank and Trust Company
	中文	美国道富银行
注册地址		美国马萨诸塞州波士顿林肯1号街
办公地址		美国马萨诸塞州波士顿林肯1号街
邮政编码		02111

2.5 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

§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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-731,615.86
本期利润	-1,208,940.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0128
本期加权平均净值利润率	-1.82%
本期基金份额净值增长率	-1.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	-27,587,124.20
期末可供分配基金份额利润	-0.3051
期末基金资产净值	66,940,476.40
期末基金份额净值	0.7404
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-25.96%

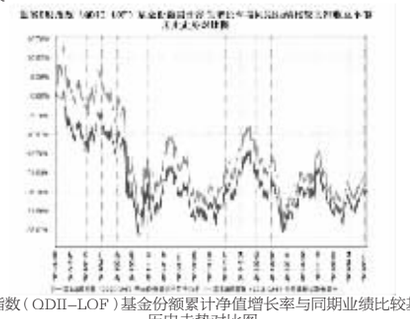
注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	2.24%	0.68%	0.58%	0.80%	1.66%	-0.12%
过去三个月	4.41%	0.79%	2.67%	0.85%	1.74%	-0.06%
过去六个月	-1.54%	0.97%	-3.53%	1.05%	1.99%	-0.08%
过去一年	12.25%	1.14%	10.60%	1.22%	1.65%	-0.08%
过去三年	-16.52%	1.47%	-21.57%	1.55%	5.05%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-25.96%	1.40%	-23.51%	1.50%	-2.45%	-0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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H股指数（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
（2010年9月30日至2014年6月30日）

注1：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。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）1、组合投资比例限制）的有关约定。

注2：2014年3月11日，本基金管理人发布《关于嘉实H股指数（QDII-LOF）基金经理变更的公告》，杨阳先生不再担任本基金基金经理；聘请杨宇先生担任本基金基金经理职务。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于1999年3月25日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。

截止2014年6月30日，基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、62只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券等证券投资基金。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨宇	本基金、嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实中证500ETF及其联接、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实深证基本面120ETF及其联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)基金经理，公司指数投资部总监	2014年3月11日	-	16年	曾先后担任平安保险投资管理中心基金交易室主任及天同基金管理有限公司投资部总经理、万家(天同)180指数基金经理。2004年7月加入嘉实基金。南开大学经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。
杨阳	本基金、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实深圳基本面120ETF、嘉实深圳基本面120ETF联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)基金经理	2013年1月25日	2014年3月11日	13年	曾任贝尔斯登高级工程师，HBK投资公司高级工程师/交易操盘手，Citadel投资集团高级数量分析师，高盛集团高级数量分析师。2008年3月加入嘉实基金任高级数量分析师。宾夕法尼亚州立大学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。

注：（1）任职日期、离任日期是指公司作出决定后公告之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII - LOF)基金合同》和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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

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，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，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过IT系统和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中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的，合计3次，均为旗下ETF因被动跟踪标的指数的需要而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运作分析

截至报告期末，本基金日均跟踪误差为0.14%，年度化拟合偏离度为2.19%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.3%的限制。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.7404元；本报告期基金份额净值增长率为-1.54%，业绩比较基准收益率为-3.53%。

4.5 管理人对宏观经济、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H股指数的被动投资管理产品，我们将继续秉承指数化被动投资策略，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，给投资者提供一个标准化的香港恒生H股指数的投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构为香港证券交易所等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

（1）报告期内本基金未实施利润分配；

（2）根据本报告3.1.1"本期利润"为-1,208,940.60元、3.1.2"期末可供分配基金份额利润"为-0.3051元、3.1.2"期末基金份额净值"为0.7404元，以及本基金基金合同（十九(三)基金收益分配原则）"3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值"的约定，因此本基金报告期内未实施利润分配，符合基金合同的约定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）
报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,603,295.41	5,046,155.92
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	62,568,008.16	66,818,267.61
其中：股票投资		62,568,008.16	66,818,267.61
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	900,630.29
应收利息	6.4.7.5	380.34	621.39
应收股利		1,403,045.57	-
应收申购款		4,268.82	13,554.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	30,247.10	-
资产总计		67,609,245.40	72,779,229.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		432,330.78	65,035.79
应付管理人报酬		41,597.62	47,583.59
应付托管费		13,865.91	15,861.21
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	180,974.69	385,404.24
负债合计		668,769.00	513,884.83
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	90,407,907.23	96,094,364.26
未分配利润	6.4.7.10	-23,467,430.83	-23,829,019.75
所有者权益合计		66,940,476.40	72,265,344.51
负债和所有者权益总计		67,609,245.40	72,779,229.34

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.7404元，基金份额总额90,407,907.23份。

6.2 利润表

公告主体：嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）
本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		-648,819.72	-14,850,230.67
1.利息收入		9,667.60	9,145.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,667.60	9,145.02
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-247,910.23	-1,238,863.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,855,910.46	-3,508,146.77
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	32,398.96
股利收益	6.4.7.16	1,608,000.23	2,236,884.23
3.公允价值变动收益	6.4.7.17	-477,324.74	-13,351,867.52
4.汇兑收益	6.4.7.21	60,339.75	-278,319.97
5.其他收入	6.4.7.18	6,407.90	9,675.38
减：二、费用		560,120.88	723,807.34
1.管理人报酬		247,112.87	337,216.53
2.托管费		82,370.92	112,405.49
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	13,086.97	40,470.05
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.20	217,550.12	233,715.27
三、利润总额		-1,208,940.60	-15,574,038.01
减：所得税费用		-	0.00
四、净利润		-1,208,940.60	-15,574,038.01

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）
本报告期：2014年1月1日 至 2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	96,094,364.26	-23,829,019.75	72,265,344.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-1,208,940.60	-1,208,940.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-5,686,457.03	1,570,529.52	-4,115,927.51
其中：1.基金申购款	5,987,400.64	-1,784,010.73	4,203,389.91
2.基金赎回款	-11,673,857.67	3,354,540.25	-8,319,317.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	90,407,907.23	-23,467,430.83	66,940,476.40
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	129,712,717.24	-25,938,692.82	103,774,024.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-15,574,038.01	-15,574,038.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-16,962,271.21	3,133,922.15	-13,828,349.06
其中：1.基金申购款	7,983,806.13	-2,154,950.61	5,828,855.52
2.基金赎回款	-24,946,077.34	5,288,872.76	-19,657,204.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	112,750,446.03	-38,378,808.68	74,371,637.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵学军　　李松林　　王红

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
美国道富银行 (State Street Bank and Trust Company)	境外资产托管人
德意志证券亚洲有限公司 (Deutsche Securities Asia Limited)	与基金管理人股东处于同一控股集团

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
德意志证券亚洲有限公司Deutsche Securities Asia Limited	-	-	2,613,883.61	11.83%

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。

6.4.4.1.2 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。

6.4.4.1.3 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。

6.4.4.1.4 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。

6.4.4.1.5 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。

6.4.4.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
德意志证券亚洲有限公司 Deutsche Securities Asia Limited	2,613.90	15.88%	-	-

注1：本期（2014年1月1日至2014年6月30日），本基金无应支付关联方的佣金。

注2：上述佣金按市场佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	247,112.87	337,216.53
其中：支付销售机构的客户维护费	51,102.09	71,789.17

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.75% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	82,370.92	112,405.49

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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)，基金管理人未运用固有资金投资本产品。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2014年6月30日）及上年度末（2013年12月31日），其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,443,747.87	9,619.90	3,859,038.51	9,061.57
美国道富银行	1,159,547.54	-	882,618.87	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人美国道富银行保管，按适用利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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)，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.5 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2014年6月30日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末（2014年6月30日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2014年6月30日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2014年6月30日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	62,568,008.16	92.54
	其中：普通股票	62,568,008.16	92.54
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	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	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,603,295.41	5.33
8	其他各项资产	1,437,941.83	2.13
	合计	67,609,245.40	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比列(%)
中国香港	62,568,008.16	93.47
合计	62,568,008.16	93.47

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比列(%)
非必需消费品	2,908,831.81	4.35
必需消费品	577,215.00	0.86
能源	13,927,934.43	20.81
金融	37,975,105.85	56.73
医疗保健	925,782.38	1.38
工业	1,651,277.81	2.47
电信服务	1,383,823.75	2.07
原材料	1,814,290.25	2.71
公用事业	1,403,746.88	2.10
合计	62,568,008.16	93.47

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。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

报告期末，本基金未持有积极投资股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比列(%)
1	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	工商银行	1398 HK	香港证券交易所	中国香港	1,537,000	5,977,969.38	8.93
2	Bank of China Ltd	中国银行	3988 HK	香港证券交易所	中国香港	2,124,000	5,850,159.75	8.74
3	PetroChina Co. Ltd.	中国石油股份	857 HK	香港证券交易所	中国香港	700,000	5,439,568.75	8.13
4	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份	386 HK	香港证券交易所	中国香港	845,600	4,960,131.05	7.41
5	Bank of Communications Co., Ltd.	交通银行	3328 HK	香港证券交易所	中国香港	1,036,400	4,401,137.38	6.57
6	China Life Insurance Co. Ltd.	中国人寿	2628 HK	香港证券交易所	中国香港	247,000	3,979,941.88	5.95
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	67,500	3,214,687.50	4.80
8	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行	3968 HK	香港证券交易所	中国香港	259,350	3,145,526.48	4.70
9	China CITIC Bank Corporation Ltd.	中信银行	998 HK	香港证券交易所	中国香港	778,000	2,902,426.25	4.34
10	Agricultural Bank of China Ltd.	农业银行	1288 HK	香港证券交易所	中国香港	765,000	2,076,688.13	3.10

注：报告期内，本基金累计买入金额前20名的权益投资仅包括上述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

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(%)
1	China Cinda Asset Management Company Ltd.	1359 HK	770,147.42	1.07
2	BYD Co. Ltd.	1211 HK	745,157.44	1.03
3	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	1398 HK	252,859.22	0.35
4	China Oilfield Services Ltd.	2883 HK	115,746.80	0.16
5	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	86,990.43	0.12
6	Bank of Communications Co., Ltd.	3328 HK	82,999.39	0.11
7	China Longyuan Power Group Corporation Ltd.	916 HK	68,538.71	0.09
8	NEW CHINA LIFE INSURANCE Co. Ltd	1336 HK	53,352.69	0.07
9	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	1988 HK	41,094.90	0.06
10	China CITIC Bank Corporation Ltd.	998 HK	18,662.18	0.03
11	PetroChina Co. Ltd.	857 HK	15,059.87	0.02
12	Agricultural Bank of China Ltd.	1288 HK	5,871.60	0.01

注：报告期内，本基金累计卖出金额前20名的权益投资仅包括上述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

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(%)
1	Bank of China Ltd	3988 HK	815,344.06	1.13
2	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	1398 HK	563,201.33	0.78
3	China CITIC Bank Corporation Ltd.	998 HK	387,444.45	0.54
4	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	274,474.51	0.38
5	Bank of Communications Co., Ltd.	3328 HK	274,385.44	0.38
6	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	1157 HK	198,037.79	0.27
7	PetroChina Co. Ltd.	857 HK	179,589.53	0.25
8	China Petroleum @&Chemical Corporation	386 HK	165,971.33	0.23
9	China Life Insurance Co. Ltd.	2628 HK	154,614.54	0.21
10	Ping An Insurance (Group) Co. of China Ltd.	2318 HK	125,366.32	0.17
11	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	119