

# 嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 QDII-LOF)

[2014] 第三季度报告

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:2014年10月24日

重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司对本基金定期报告予以复核。于2014年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，确认不存在虚假记载、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。

本报告期的财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实恒生QDII-LOF)
场内简称	恒生H
基金主代码	666717
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	84,065,150,055份
基金总资产	57,923,006,171
占基金资产净值比例(%)	92.42
报告期末基金份额净值	57,923,006,171
占基金资产净值比例(%)	92.42

## 5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	57,923,006,171	92.42
合计	57,923,006,171	92.42

## 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

### 5.3.1 报告期末按行业分类的投资及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
非必需消费品	2,738,805,16	4.37
必需消费品	525,876,46	0.84
能源	12,242,263,83	19.53
金融	35,511,912,46	56.66
医疗保健	1,006,994,77	1.61
工业	1,544,536,23	2.46
原材料	1,612,053,83	2.57
电信服务	1,354,109,16	2.48
公用事业	1,186,455,27	1.89
合计	57,923,006,171	92.42

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。

5.3.2 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

报告期末,本基金未持有按行业分类的股票及存托凭证投资组合。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

5.4.1 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及存托凭证投资明细

5.4.2 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及存托凭证投资明细

5.4.3 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及存托凭证投资明细

5.4.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

5.4.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

5.4.6 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及存托凭证投资明细

5.4.7 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及存托凭证投资明细

5.4.8 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及存托凭证投资明细

5.4.9 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及存托凭证投资明细

5.4.10 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及存托凭证投资明细

5.4.11 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及存托凭证投资明细

5.4.12 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及存托凭证投资明细

5.4.13 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及存托凭证投资明细

5.4.14 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及存托凭证投资明细

5.4.15 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及存托凭证投资明细

5.4.16 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及存托凭证投资明细

5.4.17 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及存托凭证投资明细

5.4.18 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及存托凭证投资明细

5.4.19 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及存托凭证投资明细

5.4.20 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及存托凭证投资明细

5.4.21 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及存托凭证投资明细

5.4.22 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及存托凭证投资明细

5.4.23 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及存托凭证投资明细

5.4.24 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及存托凭证投资明细

5.4.25 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及存托凭证投资明细

5.4.26 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及存托凭证投资明细

5.4.27 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及存托凭证投资明细

5.4.28 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及存托凭证投资明细

5.4.29 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及存托凭证投资明细

5.4.30 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及存托凭证投资明细

5.4.31 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及存托凭证投资明细

5.4.32 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及存托凭证投资明细

5.4.33 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及存托凭证投资明细

5.4.34 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及存托凭证投资明细

5.4.35 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及存托凭证投资明细

5.4.36 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及存托凭证投资明细

5.4.37 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及存托凭证投资明细

5.4.38 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及存托凭证投资明细

5.4.39 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及存托凭证投资明细

5.4.40 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及存托凭证投资明细

5.4.41 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及存托凭证投资明细

5.4.42 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及存托凭证投资明细

5.4.43 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及存托凭证投资明细

5.4.44 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及存托凭证投资明细

5.4.45 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及存托凭证投资明细

5.4.46 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及存托凭证投资明细

5.4.47 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及存托凭证投资明细

5.4.48 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及存托凭证投资明细

5.4.49 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及存托凭证投资明细

5.4.50 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及存托凭证投资明细

5.4.51 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及存托凭证投资明细

5.4.52 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及存托凭证投资明细

5.4.53 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及存托凭证投资明细

5.4.54 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及存托凭证投资明细

5.4.55 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及存托凭证投资明细

5.4.56 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及存托凭证投资明细

5.4.57 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及存托凭证投资明细

5.4.58 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及存托凭证投资明细

5.4.59 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及存托凭证投资明细

5.4.60 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及存托凭证投资明细

5.4.61 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及存托凭证投资明细

5.4.62 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及存托凭证投资明细

5.4.63 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及存托凭证投资明细

5.4.64 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及存托凭证投资明细

5.4.65 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及存托凭证投资明细

5.4.66 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及存托凭证投资明细

5.4.67 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及存托凭证投资明细

5.4.68 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及存托凭证投资明细

5.4.69 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及存托凭证投资明细

5.4.70 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及存托凭证投资明细

5.4.71 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及存托凭证投资明细

5.4.72 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及存托凭证投资明细

5.4.73 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及存托凭证投资明细

5.4.74 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及存托凭证投资明细

5.4.75 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及存托凭证投资明细

5.4.76 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及存托凭证投资明细

5.4.77 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及存托凭证投资明细

5.4.78 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及存托凭证投资明细

5.4.79 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及存托凭证投资明细