

信息披露 disclosure

恒生交易型开放式指数证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策一致。

7.4.2 若更正的说明
7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
中国银行股份有限公司(“中国香港”)	基金境外托管人
中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)	基金管理人、基金托管人、基金境外托管人
山东农村商业银行股份有限公司	基金管理人、基金托管人
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人、基金托管人
招商局港口投资有限公司	基金管理人、基金托管人
南方工业集团(香港)有限公司	基金管理人、基金托管人
恒生投资管理有限公司(香港)	基金管理人、基金托管人

注:1.根据华夏基金管理有限公司于2014年2月12日发布的公告,华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券(出资比例62.2%),山东省农村经济开发投资公司(出资比例10%),POWER CORPORATION OF CANADA(出资比例10%),青岛海融科技投资有限公司(出资比例10%),南方工业资产管理有限责任公司(出资比例8%)。

7.4.1.2 通过关联方交易单元进行的交易
7.4.1.1 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12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
成交金额	2,007,846.68	2,511
占当期股票交易 总额的比例	2.51%	—

7.4.1.2 权证交易
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.1.3 债券交易
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.1.4 债券回购交易
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.1.5 应支付关联方的佣金
金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期佣金	1,630.28	4.39%
占当期佣金 总额的比例	—	—

7.4.2 关联方报酬
7.4.2.1 基金管理费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.2 基金托管费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.3 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.4 基金赎回费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.5 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.6 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.7 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.8 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.9 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.10 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.11 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.12 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.13 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.14 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.15 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.16 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.17 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

7.4.2.18 基金销售服务费
金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上期可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基础费率计提的托管费	202,493.34	393,682.88

注:1.本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行托管费计提。

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	0700	4,682,659.78	3.07
2	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	00027	3,971,160.52	2.60
3	HSBC HOLDINGS PLC	0005	3,492,849.17	2.29
4	AIA GROUP LTD	01299	2,760,336.50	1.77
5	CHINA MOBILE LTD	0941	1,759,240.53	1.13
6	CHINA CONSTRUCTION BANK	0939	1,554,499.87	1.02
7	THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0823	1,221,179.94	0.79
8	IND & COMM BK OF CHINA	01398	1,208,477.67	0.79
9	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL	0386	1,193,637.77	0.79
10	BANK OF CHINA LTD	0398	955,452.03	0.63
11	CHINA MENGNIU DAIRY CO LTD	02319	923,723.71	0.61
12	HUTCHISON WHAMPOA LTD	0013	908,617.55	0.60
13	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	00388	907,663.28	0.59
14	CNOOC LTD	0883	724,989.95	0.48
15	PETROCHINA CO LTD	0857	679,242.06	0.45
16	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	09151	652,426.71	0.43
17	LENOVO GROUP LTD	00992	634,983.89	0.42
18	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	0906	594,718.80	0.39
19	CHINA LIFE INSURANCE CO	0628	579,314.80	0.38
20	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	0068	485,317.99	0.27

注:“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5.2 累计卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

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	HSBC HOLDINGS PLC	0005	6,804,217.82	4.46
2	TENCENT HOLDINGS LTD	0700	3,129,051.71	2.05
3	IND & COMM BK OF CHINA	01398	2,986,328.25	1.96
4	CHINA CONSTRUCTION BANK	0939	2,584,365.25	1.69
5	CHINA MOBILE LTD	0941	2,575,114.09	1.69
6	AIA GROUP LTD	01299	2,531,160.52	1.66
7	CHIEUNG LONG HOLDINGS LTD	00001	1,582,109.56	1.01
8	BANK OF CHINA LTD	0398	1,536,206.49	1.01
9	HUTCHISON WHAMPOA LTD	0013	1,381,029.99	0.90
10	CNOOC LTD	0883	1,294,987.10	0.85
11	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	00027	1,294,276.86	0.85
12	PETROCHINA CO LTD	0857	1,033,135.24	0.68
13	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL	0386	931,507.02	0.61
14	CHINA LIFE INSURANCE CO	0628	913,611.07	0.60
15	SANDS CHINA LTD	01928	884,915.36	0.58
16	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	00388	878,549.46	0.58
17	SWIRE PACIFIC LTD A	0019	843,884.69	0.55
18	PING AN INSURANCE GROUP CO	0518	833,604.16	0.55
19	SHANGHAI PORT GROUP LTD	00468	679,040.73	0.45
20	CHINA MERCHANTS HOLDINGS LTD	00144	630,333.36	0.41

注:“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出成本总额

单位:人民币元	买入成本总额	卖出成本总额
	34,286,392.23	46,876,416.74

注:“买入成本”、“卖出收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	HANG SENG IDX FUT Jun15	—	—
2	—	—	—	—
3	—	—	—	—
4	—	—	—	—
5	—	—	—	—

注:期货投资采用当日无负债结算制度,相关价值已包含在结算准备金中,具体投资情况详见下表(买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示):

单位:人民币元	序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
	1	股指期货	HANG SENG IDX FUT Jun15	—	—
	2	—	—	—	—
	3	—	—	—	—
	4	—	—	—	—
	5	—	—	—	—

注:期货投资采用当日无负债结算制度,相关价值已包含在结算准备金中,具体投资情况详见下表(买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示):

单位:人民币元	序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
	1	股指期货	HANG SENG IDX FUT Jun15	—	—
	2	—	—	—	—
	3	—	—	—	—
	4	—	—	—	—
	5	—	—	—	—

注:期货投资采用当日无负债结算制度,相关价值已包含在结算准备金中,具体投资情况详见下表(买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示):

单位:人民币元	序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
	1	股指期货	HANG SENG IDX FUT Jun15	—	—
	2	—	—	—	—
	3	—	—	—	—
	4	—	—	—	—
	5	—	—	—	—

注:期货投资采用当日无负债结算制度,相关价值已包含在结算准备金中,具体投资情况详见下表(买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示):

单位:人民币元	序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
	1	股指期货	HANG SENG IDX FUT Jun15	—	—
	2	—	—	—	—
	3	—	—	—	—
	4	—	—	—	—
	5	—	—	—	—

注:期货投资采用当日无负债结算制度,相关价值已包含在结算准备金中,具体投资情况详见下表(买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示):

单位:人民币元	序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
	1	股指期货	HANG SENG IDX FUT Jun15	—	—
	2	—	—	—	—
	3	—	—	—	—
	4	—	—	—	—
	5	—	—	—	—

注:期货投资采用当日无负债结算制度,相关价值已包含在结算准备金中,具体投资情况详见下表(买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示):

单位:人民币元	序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
	1	股指期货	HANG SENG IDX FUT Jun15	—	—
	2	—	—	—	—
	3	—	—	—	—
	4	—	—	—	—
	5	—	—	—	—

注:期货投资采用当日无负债结算制度,相关价值已包含在结算准备金中,具体投资情况详见下表(买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示):

11	中国银行股份有限公司-国生交易型开放式指数证券投资基金	75,593,354	55.76%
----	-----------------------------	------------	--------

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-