

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)

2014 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:2015年3月31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法律责任。
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年3月26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,保证复核内容真实、准确。

本基金的过往业绩并不预示其未来业绩,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。
基金年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细介绍,应阅读年度报告正文。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金简称, 场内简称, etc.) and Content (嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF), 嘉实恒生, etc.)

2.2 基金产品说明

本基金为被动式指数化投资,通过严格的指数复制策略和数量化的风险管理手段,力争跟踪标的指数表现,力争控制基金净值增长率与标的指数增长率之间的偏离度,力争实现基金净值增长率超越业绩比较基准收益率。
本基金为被动式指数化投资,跟踪标的恒生中国企业指数的表现,追求跟踪标的指数表现,力争控制基金净值增长率与标的指数增长率之间的偏离度,力争实现基金净值增长率超越业绩比较基准收益率。

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: Item (基金管理人, 基金托管人) and Content (嘉实基金管理有限公司, 中国建设银行股份有限公司)

2.4 境外资产托管人

Table with 2 columns: Item (名称, 英文, 中文) and Content (State Street Bank and Trust Company, 美国道富银行)

2.5 信息披露方式

Table with 2 columns: Item (基金年度报告正文的上网及查阅网址, 基金年度报告正文) and Content (http://www.jsfund.cn, 北京市建国门内大街8号华润大厦8层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: Item (3.1.1 期初数和期末数, 2014年, 2013年, 2012年), Content (3,160,133.35, -5,889,375.14, -19,532,324.30, etc.)

3.2 基金净值表现

Table with 2 columns: Item (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), Content (过去三个月, 过去六个月, 过去一年, etc.)

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

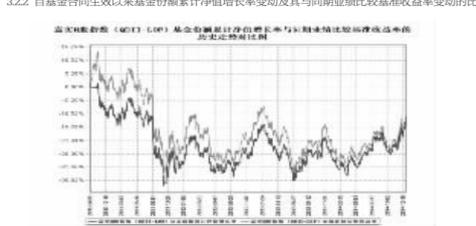
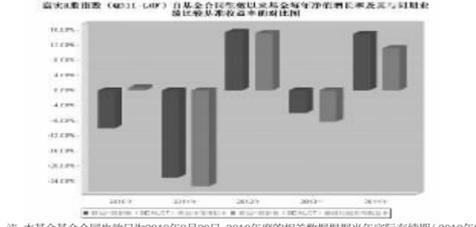


图:嘉实恒生指数(QDII-LOF)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:1.按基金合同和招募说明书约定,本基金自基金合同生效之日起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(十二)投资范围(六)1.组合投资比例限制的有关约定。
注:2.自2014年1月1日至本报告期末,本基金管理人发布《关于嘉实恒生指数(QDII-LOF)基金基金经理变更的公告》,杨松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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金基金合同生效日为2010年9月30日,2010年度的相关数据根据当年实际存续期(2010年9月30日至2010年12月31日)计算。

4.1 基金管理人及基金托管情况

4.1.1 基金管理人及基金托管人的基本情况

基金管理人: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。
基金托管人:中国建设银行股份有限公司,总行在北京,设有50个分行,2919个营业网点。

4.1.2 基金基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理情况

Table with 4 columns: Name, Position, Term, Description (杨宇, 基金经理, 2014年3月11日, etc.)

4.2 基金管理人及基金托管人报告期内履行职责的情况

基金管理人:嘉实基金管理有限公司,报告期内严格按照基金合同约定,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。
基金托管人:中国建设银行股份有限公司,报告期内严格按照基金合同约定,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 基金管理人报告期内基金投资运作情况的说明

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,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。
报告期内,本基金管理人严格遵守基金合同约定,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.4 基金管理人报告期内基金投资运作情况的说明

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,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。
报告期内,本基金管理人严格遵守基金合同约定,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

截至本报告期末本基金份额净值为30.8632元;本报告期基金份额净值增长率为14.88%,业绩比较基准收益率为11.18%。

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
本基金跟踪的恒生中国企业指数成分股均为在香港上市交易的内地公司,企业盈利增速的波动源于国内经济周期的波动,自场内交易主体主要由欧美等海外资金构成,流动性受欧美等发达经济体的直接影响较大。
报告期内,恒生中国企业指数涨幅:上涨10.8%。

4.6 管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.7 管理人对于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“基金概况”中“3.1.2 期末可供分配基金份额净值”为-0.3425元,3.1.2“期末基金份额净值”为0.8030元,以及本基金基金合同(十九)“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;即基金收益分配前基金份额净值低于面值的基金份额净值由基金管理人补足,基金份额净值不能低于面值”的约定,因此本基金报告期内未实施利润分配,符合基金合同约定。

4.8 报告期内基金管理人对于本基金资产净值估值程序的说明

本基金管理人估值委员会,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会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,固定收益组负责人同时兼任基金估值、估值委员,基金估值委员会由基金估值委员会、基金估值委员会、基金估值委员会组成,基金估值委员会由基金估值委员会、基金估值委员会、基金估值委员会组成。

4.9 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.10 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.11 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.12 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.13 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.14 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.15 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.16 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.17 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.18 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.19 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.20 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.21 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.22 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.23 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.24 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.25 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.26 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.27 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.28 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.29 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.30 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.31 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.32 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.33 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.34 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.35 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.36 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.37 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.38 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.39 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.40 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.41 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.42 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.43 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.44 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.45 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.46 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.47 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.48 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

4.49 基金管理人对于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会计部门负责,基金托管人复核,并由基金管理人完成估值核算,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年末估值核算与基金会计系统核对相符。

7.4.1.2 债券交易

本期(2014年1月1日至2014年12月31日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.1.3 债券回购交易

本期(2014年1月1日至2014年12月31日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.1.4 基金交易

本期(2014年1月1日至2014年12月31日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.1.5 权证交易

本期(2014年1月1日至2014年12月31日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.1.6 股指期货交易

本期(2014年1月1日至2014年12月31日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股指期货交易。

7.4.1.7 其他衍生品交易

本期(2014年1月1日至2014年12月31日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行其他衍生品交易。

7.4.1.8 关联方关系

关联方名称 本期 2014年1月1日至2014年12月31日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日

Table with 4 columns: Name, Amount, Ratio, etc. (嘉实证券资产管理有限公司, 5,894.14, 20.40%, etc.)

7.4.2 关联方关系

注:本基金管理人中国建设银行股份有限公司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:日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.2.1 基金托管费

项目 本期 2014年1月1日至2014年12月31日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日

Table with 4 columns: Item, Amount, Ratio, etc. (当期发生的基金托管费, 496,228.15, 625,712.91, etc.)

7.4.2.2 基金托管费

注:本基金管理人中国建设银行股份有限公司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:日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.2.3 基金托管费

项目 本期 2014年1月1日至2014年12月31日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日

Table with 4 columns: Item, Amount, Ratio, etc. (当期发生的基金托管费, 166,075.89, 206,570.99, etc.)

7.4.2.4 基金托管费

注:本基金管理人中国建设银行股份有限公司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:日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.2.5 基金托管费

项目 本期 2014年1月1日至2014年12月31日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日

Table with 4 columns: Item, Amount, Ratio, etc. (当期发生的基金托管费, 3,222,481.43, 19,001.31, etc.)

7.4.2.6 基金托管费

注:本基金管理人中国建设银行股份有限公司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:日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.2.7 基金托管费

项目 本期 2014年1月1日至2014年12月31日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日

Table with 4 columns: Item, Amount, Ratio, etc. (当期发生的基金托管费, 2,857,673.58, 2,869,086.08, etc.)

7.4.2.8 基金托管费

注:本基金管理人中国建设银行股份有限公司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:日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.2.9 基金托管费

项目 本期 2014年1月1日至2014年12月31日