

## 嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)

### 【2015】第二季度报告

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:2015年7月18日

#### §1 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法律责任。

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2015年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现。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。

本报告期内无财务资料未审计。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

#### §2 基金产品概况

基金简称	恒生中国企业(QDII-LOF)
基金代码	160717
基金运作方式	上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2010年9月30日
报告期末基金份额总额	887,320,215.42份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的跟踪偏离度和组合投资风险管理,力争使本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于70.26%,跟踪误差不得超过4%,以实现对恒生中国企业指数的有效投资。
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投资组合。
业绩比较基准	恒生中国企业指数
风险收益特征	恒生中国企业指数
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
境外资产托管人	英文名称:State Street Bank and Trust Company 中文名称:美国道富银行

#### §3 主要财务指标和基金净值表现

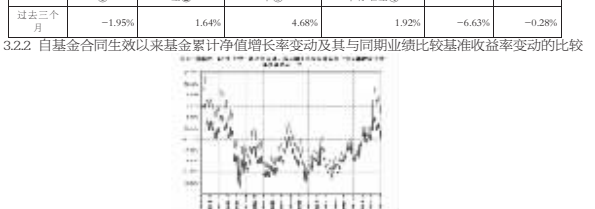
主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	报告期末(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	-6,637,596.61
2.本期利润	-71,781,803.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0732
4.期末基金资产净值	761,940,783.84
5.期末基金份额净值	0.8576

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。

#### 3.2.1 本报告期末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	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	-1.93%	1.64%	4.68%	1.92%	-6.63%
过去一年	-1.93%	1.64%	4.68%	1.92%	-6.63%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:按基金合同约定和招募说明书的规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。建仓期结束时各项投资比例符合基金合同(十四)(二)投资范围及(七)(1)组合投资比例限制。有约约束。

#### §4 管理人报告

##### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理任期	证券从业年限	说明
杨宇	基金经理	2014年3月11日	17年	曾任前任平安基金助理和资产管理中心基金交易室主任及大成基金管理有限公司投资管理部总经理,万安(天津)1800指数基金,2004年7月加入嘉实基金,曾任基金经理。现任嘉实基金(QDII-LOF)基金经理,公司首席国际投资官。

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。

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.2 公平交易专项说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况  
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.3 公平交易专项说明

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《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现  
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.5 管理人对外宏观观点

4.5.1 管理人对外宏观观点  
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

4.6.1 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明  
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### §5 投资组合报告

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	718,816,994.37	80.59
其中:普通股	718,816,994.37	80.59	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	其他资产	-	-
6	负债及承诺	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他资产	-	-
9	其他资产	-	-

##### §3 主要财务指标和基金净值表现

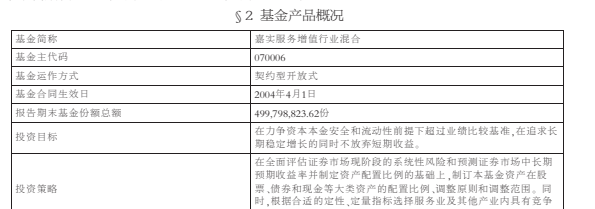
主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	报告期末(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,075,917,808.84
2.本期利润	69,313,176.80
3.加权平均基金份额本期利润	1.1551
4.期末基金资产净值	3,563,366,224.34
5.期末基金份额净值	1.1301

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)上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。

#### 3.2.1 本报告期末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	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	16.71%	2.87%	15.83%	2.11%	0.68%
过去一年	16.71%	2.87%	15.83%	2.11%	0.68%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:按基金合同约定,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投资比例符合基金合同第十二条(二)投资范围和(三)投资组合比例限制的规定:(1)在正常市场情况下,本基金资产配置比例如下:股票资产占基金资产比例不低于80%;债券资产占基金资产比例不高于20%;现金资产占基金资产比例不高于5%。(2)本基金投资于同一原始权益人的各类资产,其比例不得超过基金资产净值的10%。(3)本基金与由基金管理人管理的其他基金(2)持有一家公司的股票,不得超过该基金资产净值的10%。(4)法律法规规定的其他基金限制。

##### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理任期	证券从业年限	说明
曹伟	基金经理	2015年3月12日	10年	曾任大成基金资产管理(上海)有限公司研究部,泰达利基金资产管理(上海)有限公司研究部,2014年1月加入嘉实基金,曾任基金经理。现任嘉实基金(QDII-LOF)基金经理,公司首席国际投资官。

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。

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.3 公平交易专项说明

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《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现  
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.5 管理人对外宏观观点

4.5.1 管理人对外宏观观点  
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

4.6.1 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明  
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### §5 投资组合报告

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,123,411,341.04	76.97
其中:普通股	3,123,411,341.04	76.97	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	其他资产	-	-
6	负债及承诺	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他资产	-	-
9	其他资产	-	-

##### §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	报告期末(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,075,917,808.84
2.本期利润	69,313,176.80
3.加权平均基金份额本期利润	1.1551
4.期末基金资产净值	3,563,366,224.34
5.期末基金份额净值	1.1301

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)上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。

#### 3.2.1 本报告期末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	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	16.71%	2.87%	15.83%	2.11%	0.68%
过去一年	16.71%	2.87%	15.83%	2.11%	0.68%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:按基金合同约定,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投资比例符合基金合同第十二条(二)投资范围和(三)投资组合比例限制的规定:(1)在正常市场情况下,本基金资产配置比例如下:股票资产占基金资产比例不低于80%;债券资产占基金资产比例不高于20%;现金资产占基金资产比例不高于5%。(2)本基金投资于同一原始权益人的各类资产,其比例不得超过基金资产净值的10%。(3)本基金与由基金管理人管理的其他基金(2)持有一家公司的股票,不得超过该基金资产净值的10%。(4)法律法规规定的其他基金限制。

##### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理任期	证券从业年限	说明
曹伟	基金经理	2015年3月12日	10年	曾任大成基金资产管理(上海)有限公司研究部,泰达利基金资产管理(上海)有限公司研究部,2014年1月加入嘉实基金,曾任基金经理。现任嘉实基金(QDII-LOF)基金经理,公司首席国际投资官。

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。

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.3 公平交易专项说明

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《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现  
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.5 管理人对外宏观观点

4.5.1 管理人对外宏观观点  
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

4.6.1 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明  
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### §5 投资组合报告

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,123,411,341.04	76.97
其中:普通股	3,123,411,341.04	76.97	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	其他资产	-	-
6	负债及承诺	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他资产	-	-
9	其他资产	-	-

##### §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	报告期末(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,075,917,808.84
2.本期利润	69,313,176.80
3.加权平均基金份额本期利润	1.1551
4.期末基金资产净值	3,563,366,224.34
5.期末基金份额净值	1.1301

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)上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。

#### 3.2.1 本报告期末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	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	16.71%	2.87%	15.83%	2.11%	0.68%
过去一年	16.71%	2.87%	15.83%	2.11%	0.68%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:按基金合同约定,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投资比例符合基金合同第十二条(二)投资范围和(三)投资组合比例限制的规定:(1)在正常市场情况下,本基金资产配置比例如下:股票资产占基金资产比例不低于80%;债券资产占基金资产比例不高于20%;现金资产占基金资产比例不高于5%。(2)本基金投资于同一原始权益人的各类资产,其比例不得超过基金资产净值的10%。(3)本基金与由基金管理人管理的其他基金(2)持有一家公司的股票,不得超过该基金资产净值的10%。(4)法律法规规定的其他基金限制。

##### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理任期	证券从业年限	说明
曹伟	基金经理	2015年3月12日	10年	曾任大成基金资产管理(上海)有限公司研究部,泰达利基金资产管理(上海)有限公司研究部,2014年1月加入嘉实基金,曾任基金经理。现任嘉实基金(QDII-LOF)基金经理,公司首席国际投资官。

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。

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.3 公平交易专项说明

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《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现  
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.5 管理人对外宏观观点

4.5.1 管理人对外宏观观点  
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### 4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

4.6.1 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明  
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金(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。本基金运作符合法律法规和基金合同约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

##### §5 投资组合报告

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,123,411,341.04	76.97
其中:普通股	3,123,411,341.04	76.97	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	其他资产	-	-
6	负债及承诺	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他资产	-	-
9	其他资产	-	-

##### §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	报告期末(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,075,917,808.84
2.本期利润	69,313,176.80
3.加权平均基金份额本期利润	1.1551
4.期末基金资产净值	3,563,366,224.34
5.期末基金份额净值	1.1301

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)上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。

#### 3.2.1 本报告期末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