

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

基金管理人的前董事会有权对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其进行内容的真实性、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根据本基金合同规定，于2015年7月15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，确认本报告不存在虚假记载、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。

报告期期间的财务数据未经审计。

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	嘉实恒生指数(QDII-LOF)(场内简称:恒生H股)
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
报告期末基金份额总额	887,320,215.42份
投资目标	本基金通过被动指数化投资，通过严控的估值纪律和恰当的量化风格管理手段，力争控制本基金的净值增长与业绩比较基准之间的日均跟踪误差小于0.3%，跟踪误差不高于4%，从而在一定程度上降低本基金的跟踪误差。
投资策略	本基金主要投资于恒生指数成份股，按照其在恒生中国企业指数中的权重比例构建股票投资组合。
业绩比较基准	人民币汇率中间价计算的恒生中国企业指数
风险收益特征	较高风险，较高收益
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	美国富国银行 英文名称:State Bank and Trust Company 中文名称:美国富国银行

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 ~ 2015年6月30日)			
	年初至报告期期初	报告期	报告期	年初至报告期期初
1.本期实现收益		-6,637,396.61		
2.本期利润	-71,781,803.64			
3.期初至报告期期初基金利润	-10,732			
4.期末基金资产净值	761,004,783.81			
5.期末可供分配基金份额利润	0.8576			
6.本期末可供分配利润	0.8576			
7.期末可供分配利润	0.8576			
8.期末基金资产净值	761,004,783.81			
9.期末可供分配利润	0.8576			
10.期末基金资产总额	761,860,539.67			

注:1)本期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，本期利润指本期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，费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 净值增长率标准差② 基准收益率③ 基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.95% 4.68% 1.92% -6.63% -0.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率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走势对比图(2010年9月30日至2015年6月30日)

注:按基金合同和招募说明书中约定,本基金基金合同生效日起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)的有关规定。

3.3 主要财务指标

3.3.1 基金管理人报告

报告期(2015年4月1日 ~ 2015年6月30日)

报告期(2015年4月1日 ~ 201