

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF) 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

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：2016 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2016 年 8 月 24 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	34
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细	35
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	39
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	41
7.7 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	41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.9 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	42
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	42
7.11 投资组合报告附注	42

§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末上市基金前十名持有人	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	44
§9 开放式基金份额变动	44
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	47
§11 备查文件目录	48
11.1 备查文件目录	48
11.2 存放地点	48
11.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF)
基金简称	嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)
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
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
报告期末基金份额总额	3,590,895,179.51 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 10 月 28 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%,年跟踪误差不超过 4%,以实现恒生中国企业指数的有效跟踪,给投资者提供一个投资恒生中国企业指数的有效投资工具。
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指数化投资组合。
业绩比较基准	人民币/港币汇率×恒生中国企业指数
风险收益特征	本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	田青
	联系电话	(010) 65215588	(010) 67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	(010) 67595096
传真		(010) 65182266	(010) 66275853
注册地址		中国(上海)自由贸易试验	北京市西城区金融大街 25 号

	区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元	
办公地址	北京市建国门北大街8号 华润大厦8层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	100005	100033
法定代表人	邓红国	王洪章

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	State Street Bank and Trust Company
	中文	美国道富银行
注册地址		美国马萨诸塞州波士顿林肯1号街
办公地址		美国马萨诸塞州波士顿林肯1号街
邮政编码		02111

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	10,637,478.78
本期利润	50,519,316.84
加权平均基金份额本期利润	0.0533
本期加权平均净值利润率	8.57%

本期基金份额净值增长率	-6.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	-1,822,169,273.39
期末可供分配基金份额利润	-0.5074
期末基金资产净值	2,336,659,894.89
期末基金份额净值	0.6507
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-34.93%

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) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

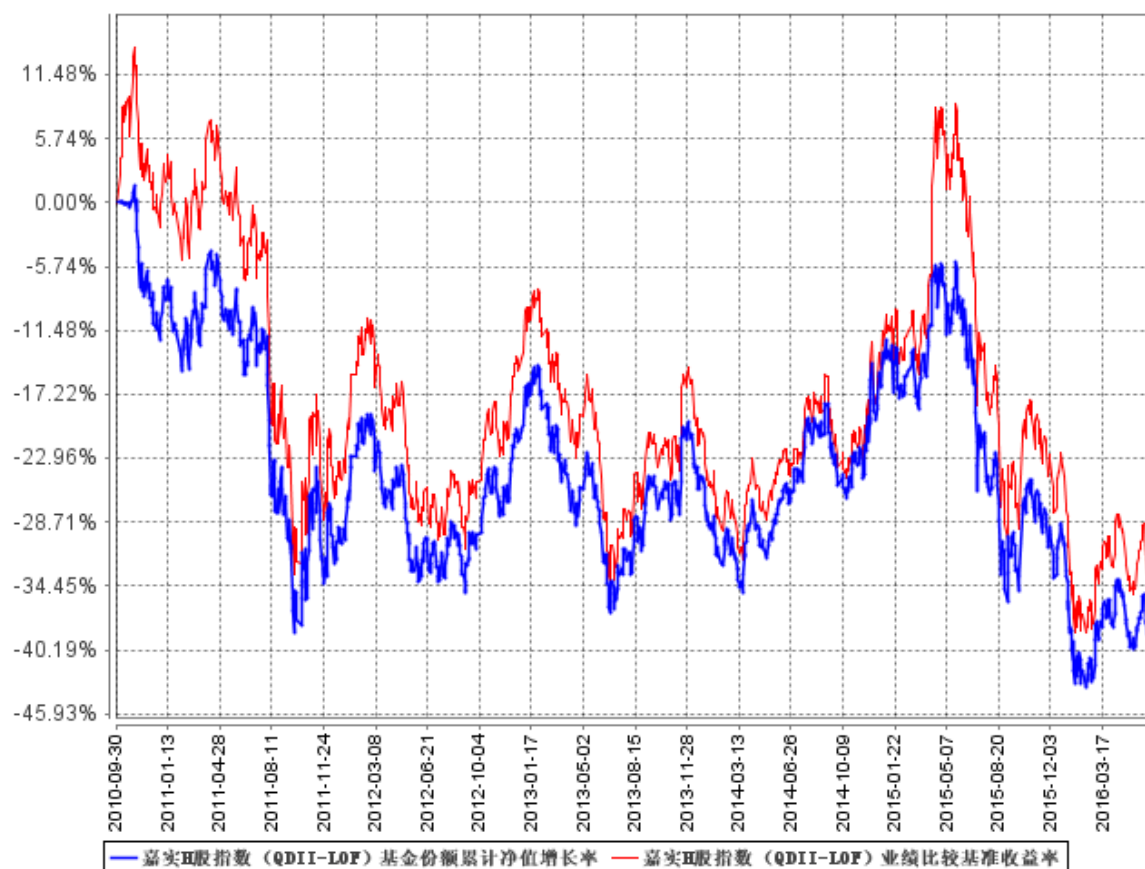
3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.75%	1.44%	1.02%	1.56%	2.73%	-0.12%
过去三个月	1.21%	1.28%	-0.74%	1.37%	1.95%	-0.09%
过去六个月	-6.09%	1.58%	-8.00%	1.67%	1.91%	-0.09%
过去一年	-24.13%	1.69%	-27.26%	1.79%	3.13%	-0.10%
过去三年	-1.35%	1.40%	0.40%	1.52%	-1.75%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-34.93%	1.44%	-30.56%	1.55%	-4.37%	-0.11%

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

嘉实H股指数（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



图：嘉实H股指数（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

（2010年9月30日至2016年6月30日）

注1：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项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）的有关约定。

注2：2016年1月5日，本基金管理人发布《关于嘉实H股指数（QDII-LOF）基金经理变更的公告》，杨宇先生不再担任本基金基金经理职务，聘请何如女士、陈正宪先生担任本基金基金经理职务。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为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。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2016 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、93 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300 ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯

债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何如	本基金、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 及其联接、嘉实沪深 300ETF 及其联接、嘉实中证 500ETF 及其联接、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实深证基本面 120ETF 及其联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF) 基金经理	2016 年 1 月 5 日	-	10 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司, 先后任职于产品管理部、指数投资部, 现任指数投资部副总监、基金经理。硕士研究生, 具有基金从业资格, 加拿大籍。
陈正宪	本基金、嘉实沪深 300ETF 及其联接、嘉实中证 500ETF 及其联接、嘉实中创 400ETF 及其联接、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF) 基金经理	2016 年 1 月 5 日	-	11 年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司, 先后任职于产品管理部、指数投资部, 现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生, 具有基金从业资格, 中国台湾籍。
杨宇	本基金、嘉实沪深 300ETF、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实中证 500ETF 及其联接、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实深证基本面 120ETF 及其联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF) 基金经理, 公司指数投资部总监	2014 年 3 月 11 日	2016 年 1 月 5 日	17 年	曾先后担任平安保险投资管理中心基金交易室主任及天同基金管理有限公司投资部总经理、万家 (天同) 180 指数基金经理。2004 年 7 月加入嘉实基金。南开大学经济学硕士, 具有基金从业资格, 中国国籍。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII - LOF) 基金合同》和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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定, 无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度, 各投资组合按投资管理制度和流程独立决策, 并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会; 通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进, 确保公平交易原则的实现; 通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控, 公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内, 公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中, 同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的, 合计 1 次, 为旗下组合被动跟踪标的指数需要, 与其他组合发生反向交易, 不存在利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内, 本基金整体日均跟踪误差为 0.19%, 年度化拟合偏离度为 2.97%, 符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.3% 的限制。本基金跟踪误差来源主要包括: 基金申购赎回的影响、限制投资股票的替代选择、单个股票最高仓位限制、人民币港币的汇率变化等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.6507 元; 本报告期基金份额净值增长率为 -6.09%, 业绩比较基准收益率为 -8.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于香港恒生 H 股指数的被动投资管理产品, 我们将继续秉承指数化被动

投资策略,积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,力争进一步降低本基金的跟踪误差,给投资者提供一个标准化的香港恒生 H 股指数的投资工具。

4.6 管理人对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与基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会,委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规部等部门负责人组成,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,固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员,基金经理参加估值专业委员会会议,但不介入基金日常估值业务;参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所,中国证券登记结算有限责任公司,中央国债登记结算公司,中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对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 3.1.2 “期末可供分配利润”为 -1,822,169,273.39 元、3.1.2 “期末基金份额净值”为 0.6507 元,以及本基金基金合同(十九(三)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;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值”的约定,因此本基金报告期内未实施利润分配,符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	113,448,050.91	23,863,555.41
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,180,002,953.50	389,495,394.03
其中：股票投资		2,180,002,953.50	389,495,394.03
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,743,728.17
应收利息	6.4.7.5	40,375.87	3,696.22
应收股利		45,962,392.43	-
应收申购款		5,266,062.80	5,122,801.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,344,719,835.51	421,229,175.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		322.63	-
应付赎回款		5,657,388.47	8,245,552.84
应付管理人报酬		958,655.33	253,847.94
应付托管费		319,551.75	84,615.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	711,770.36	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	412,252.08	501,943.34
负债合计		8,059,940.62	9,085,960.09
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,590,895,179.51	594,806,600.49
未分配利润	6.4.7.10	-1,254,235,284.62	-182,663,384.92
所有者权益合计		2,336,659,894.89	412,143,215.57
负债和所有者权益总计		2,344,719,835.51	421,229,175.66

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6507 元，基金份额总额 3,590,895,179.51 份。

6.2 利润表

公告主体：嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		57,353,633.74	-64,747,716.02
1. 利息收入		281,443.18	91,049.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	281,443.18	91,049.99
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		18,605,722.04	7,546,741.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-28,297,074.67	-8,636,303.54

基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	46,902,796.71	16,183,044.61
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	39,881,838.06	-62,258,264.78
4. 汇兑收益	6.4.7.21	-1,568,909.18	-10,669,065.44
5. 其他收入	6.4.7.18	153,539.64	541,823.14
减：二、费用		6,834,316.90	5,439,441.24
1. 管理人报酬		2,152,482.08	1,843,666.99
2. 托管费		717,494.06	614,555.64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,510,661.71	2,675,125.57
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	453,679.05	306,093.04
三、利润总额		50,519,316.84	-70,187,157.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润		50,519,316.84	-70,187,157.26

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	594,806,600.49	-182,663,384.92	412,143,215.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	50,519,316.84	50,519,316.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,996,088,579.02	-1,122,091,216.54	1,873,997,362.48
其中：1. 基金申购款	3,191,046,772.03	-1,193,530,913.12	1,997,515,858.91
2. 基金赎回款	-194,958,193.01	71,439,696.58	-123,518,496.43
四、本期向基金份额持	-	-	-

有人分配利润产生的基金净值变动			
五、期末所有者权益(基金净值)	3,590,895,179.51	-1,254,235,284.62	2,336,659,894.89
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	81,420,410.56	-11,085,130.05	70,335,280.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-70,187,157.26	-70,187,157.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	805,899,804.86	-45,043,144.30	760,856,660.56
其中：1.基金申购款	1,304,516,627.15	-97,348,730.62	1,207,167,896.53
2.基金赎回款	-498,616,822.29	52,305,586.32	-446,311,235.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	887,320,215.42	-126,315,431.61	761,004,783.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>赵学军</u>	<u>王红</u>	<u>常旭</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII - LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]479号《关于核准嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII - LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,016,732,573.62 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 250 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实恒生中国企业

指数证券投资基金(QDII - LOF)基金合同》于 2010 年 9 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,016,850,356.49 份基金份额,其中认购资金利息折合 117,782.87 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外资产托管人为美国道富银行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII - LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股、备选股、同一标的指数的 ETF、以及依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、现金、短期金融工具、同一标的指数的股指期货、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中成份股及备选股投资比例不低于基金资产的 90%;权证市值不超过基金资产净值的 3%;现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为人民币/港币汇率 X 恒生中国企业指数。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第 343 号文审核同意,本基金 337,699,345.00 份基金份额于 2010 年 10 月 28 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。目前基金取得的源自境外的差价收入,在境内不予征收营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免征增值税:a) 同业存款;b) 买入返售金融资产(质押式、买断式);c) 国债、地方政府债;d) 金融债券。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的其他收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	113,448,050.91
定期存款	—
其中:存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计:	113,448,050.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,249,956,238.41	2,180,002,953.50	-69,953,284.91
贵金属投资-金交所	—	—	—

黄金合约				
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2, 249, 956, 238. 41	2, 180, 002, 953. 50	-69, 953, 284. 91

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	19, 066. 50
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	17, 178. 84
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	4, 130. 53
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	40, 375. 87

6.4.7.6 其他资产

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	711,770.36
银行间市场应付交易费用	-
合计	711,770.36

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	22,092.52
预提费用	313,822.70
应付指数使用费	76,336.86
其他	-
合计	412,252.08

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	594,806,600.49	594,806,600.49
本期申购	3,191,046,772.03	3,191,046,772.03
本期赎回	-194,958,193.01	-194,958,193.01
本期末	3,590,895,179.51	3,590,895,179.51

6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-279,527,201.96	96,863,817.04	-182,663,384.92
本期利润	10,637,478.78	39,881,838.06	50,519,316.84
本期基金份额交易产生的变动数	-1,553,279,550.21	431,188,333.67	-1,122,091,216.54
其中：基金申购款	-1,650,715,834.47	457,184,921.35	-1,193,530,913.12
基金赎回款	97,436,284.26	-25,996,587.68	71,439,696.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,822,169,273.39	567,933,988.77	-1,254,235,284.62

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	105,086.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	87,866.33
其他	88,490.37
合计	281,443.18

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	83,427,078.42
减：卖出股票成本总额	111,724,153.09
买卖股票差价收入	-28,297,074.67

6.4.7.13 基金投资收益

本期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	46,902,796.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	46,902,796.71

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	39,881,838.06
——股票投资	39,881,838.06
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	39,881,838.06

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	153,539.64
基金转出费收入	—
债券认购手续费返还	—
印花税手续费返还	—
其他	—
合计	153,539.64

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	3,510,661.71
银行间市场交易费用	—
合计	3,510,661.71

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	34,809.32
信息披露费	149,178.12
债券托管账户维护费	-
银行划款手续费	2,313.08
指数使用费	114,799.00
上市年费	29,835.26
红利手续费	-
其他	122,744.27
合计	453,679.05

6.4.7.21 汇兑收益

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
汇兑收益	-1,568,909.18
合计	-1,568,909.18

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
美国道富银行（State Street Bank and Trust Company）	境外资产托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2016年1月1日至2016年6月30日)及上年度可比期间(2015年1月1日至2015年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,152,482.08	1,843,666.99
其中:支付销售机构的客户维护费	161,840.87	182,686.48

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%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:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	717,494.06	614,555.64

注:支付基金托管人中国建设银行的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:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期(2016年1月1日至2016年6月30日)及上年度可比期间(2015年1月1日至2015年6月30日),本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内(2016年1月1日至2016年6月30日)及上年度可比期间(2015年1月1日至2015

年 6 月 30 日), 基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末 (2016 年 6 月 30 日) 及上年度末 (2015 年 12 月 31 日), 其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	112,531,617.81	105,086.48	96,188,156.29	88,748.10
美国道富银行	916,433.10	-	4,897,549.50	-

注: 本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人美国道富银行保管, 按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期 (2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日) 及上年度可比期间 (2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日), 本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本期 (2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末 (2016 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末 (2016 年 6 月 30 日), 本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末 (2016 年 6 月 30 日), 本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末 (2016 年 6 月 30 日), 本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末 (2016 年 6 月 30 日), 本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。同时，本基金为海外证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.3%，年跟踪误差不超过4%，以实现对中国企业指数的有效跟踪，给投资者提供一个投资恒生中国企业指数的有效投资工具。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在境内和境外托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与境外当地授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金未持有债券投资(上年度末：无)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场或柜台市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计

息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	6个月以内	不计息	合计
资产			
银行存款	113,448,050.91	-	113,448,050.91
结算备付金	-	-	-
存出保证金	-	-	-
交易性金融资产	-	2,180,002,953.50	2,180,002,953.50
衍生金融资产	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-
应收利息	-	40,375.87	40,375.87
应收股利	-	45,962,392.43	45,962,392.43
应收申购款	5,031,405.57	234,657.23	5,266,062.80
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	118,479,456.48	2,226,240,379.03	2,344,719,835.51
负债			
短期借款	-	-	-

交易性金融负债	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-
应付证券清算款	-	322.63	322.63
应付赎回款	-	5,657,388.47	5,657,388.47
应付管理人报酬	-	958,655.33	958,655.33
应付托管费	-	319,551.75	319,551.75
应付销售服务费	-	-	-
应付交易费用	-	711,770.36	711,770.36
应交税费	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	-	412,252.08	412,252.08
负债总计	-	8,059,940.62	8,059,940.62
利率敏感度缺口	118,479,456.48	2,218,180,438.41	2,336,659,894.89
上年度末 2015 年 12 月 31 日	6 个月以内	不计息	合计
资产			
银行存款	23,863,555.41	-	23,863,555.41
结算备付金	-	-	-
存出保证金	-	-	-
交易性金融资产	-	389,495,394.03	389,495,394.03
衍生金融资产	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-
应收证券清算款	-	2,743,728.17	2,743,728.17
应收利息	-	3,696.22	3,696.22
应收股利	-	-	-
应收申购款	115,141.56	5,007,660.27	5,122,801.83
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	23,978,696.97	397,250,478.69	421,229,175.66
负债			
短期借款	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-
应付赎回款	-	8,245,552.84	8,245,552.84
应付管理人报酬	-	253,847.94	253,847.94
应付托管费	-	84,615.97	84,615.97
应付销售服务费	-	-	-
应付交易费用	-	-	-
应交税费	-	-	-

应付利息	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	-	501,943.34	501,943.34
负债总计	-	9,085,960.09	9,085,960.09
利率敏感度缺口	23,978,696.97	388,164,518.60	412,143,215.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2016年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2015年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	916,583.98	-	916,583.98
交易性金融资产	-	2,180,002,953.50	-	2,180,002,953.50
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	255,467.70	-	255,467.70
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	2,181,175,005.18	-	2,181,175,005.18
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,181,175,005.18	-	2,181,175,005.18
项目	上年度末 2015年12月31日			

	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	74,227.29	-	74,227.29
交易性金融资产	-	389,495,394.03	-	389,495,394.03
应收证券清算款	-	2,743,728.17	-	2,743,728.17
应收利息	-	4.98	-	4.98
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	392,313,354.47	-	392,313,354.47
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	392,313,354.47	-	392,313,354.47

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	109,058,750.26	19,615,667.72
	所有外币相对人民币贬值 5%	-109,058,750.26	-19,615,667.72

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(如流动性原因)导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置,通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,180,002,953.50	93.30	389,495,394.03	94.50
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,180,002,953.50	93.30	389,495,394.03	94.50

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	109,823,015.07	18,386,264.22
	业绩比较基准下降 5%	-109,823,015.07	-18,386,264.22

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,180,002,953.50 元，无属于第二、第三层次的余额（上年度末：第一层次 389,495,394.03 元，无属于第二、第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,180,002,953.50	92.97
	其中：普通股票	2,180,002,953.50	92.97
	存托凭证	—	—
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	113,448,050.91	4.84
8	其他各项资产	51,268,831.10	2.19
	合计	2,344,719,835.51	100.00

注：通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 1,489,413,764.43 元，占基金净值的比例为 63.74%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	2,180,002,953.50	93.30
合计	2,180,002,953.50	93.30

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
非必需消费品	66,367,245.07	2.84
必需消费品	9,133,260.02	0.39
能源	296,918,366.35	12.71
金融	1,536,592,036.16	65.76
医疗保健	41,710,938.63	1.79
工业	94,015,785.39	4.02
原材料	30,963,822.34	1.33
电信服务	45,445,607.22	1.94
公用事业	58,855,892.32	2.52
合计	2,180,002,953.50	93.30

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。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

报告期末，本基金未持有积极投资股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	工商银行	1398 HK	香港证券交易所	中国香港	52,749,000	193,406,017.80	8.28
2	Bank of China Ltd	中国银行	3988 HK	香港证券交易所	中国香港	68,774,000	181,627,340.45	7.77
3	Ping An Insurance (Group) Co. of China Ltd.	中国平安	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	5,983,000	174,625,704.33	7.47
4	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行	3968 HK	香港证券交易所	中国香港	11,213,350	166,181,598.06	7.11
5	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份	386 HK	香港证券交易所	中国香港	28,253,600	135,226,024.15	5.79
6	China Life Insurance Co. Ltd.	中国人寿	2628 HK	香港证券交易所	中国香港	8,240,000	117,046,030.89	5.01
7	PetroChina Co. Ltd.	中国石油股份	857 HK	香港证券交易所	中国香港	23,364,000	105,633,417.27	4.52
8	Bank of Communications Co., Ltd.	交通银行	3328 HK	香港证券交易所	中国香港	24,665,400	103,085,001.57	4.41
9	Agricultural	农业银	1288 HK	香港	中国香港	41,067,000	99,329,414.08	4.25

	Bank of China Ltd.	行		证券 交易 所	港			
10	China CITIC Bank Corporation Ltd.	中信银行	998 HK	香港 证券 交易 所	中国香港	23,453,000	94,409,950.65	4.04
11	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	民生银行	1988 HK	香港 证券 交易 所	中国香港	11,933,500	76,290,049.25	3.26
12	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	中国太保	2601 HK	香港 证券 交易 所	中国香港	2,766,000	61,700,849.44	2.64
13	China Shenhua Energy Co. Ltd.	中国神华	1088 HK	香港 证券 交易 所	中国香港	3,763,500	45,868,010.78	1.96
14	China Telecom Corporation Ltd.	中国电信	728 HK	香港 证券 交易 所	中国香港	15,368,000	45,445,607.22	1.94
15	PICC Property and Casualty Co. Ltd.	中国财险	2328 HK	香港 证券 交易 所	中国香港	4,328,389	44,836,052.03	1.92
16	Sinopharm Group Co. Ltd	国药控股	1099 HK	香港 证券 交易 所	中国香港	1,320,800	41,710,938.63	1.79
17	Citic Securities Co. Ltd	中信证券	6030 HK	香港 证券 交易 所	中国香港	2,505,000	36,396,121.95	1.56
18	China Communications Construction Co. Ltd.	中国交通建设	1800 HK	香港 证券 交易 所	中国香港	4,903,000	34,780,710.18	1.49
19	Haitong Securities Co., Ltd.	海通证券	6837 HK	香港 证券 交易 所	中国香港	3,020,400	33,662,046.30	1.44
20	HUATAI SECURITIES CO	华泰证券	6886 HK	香港 证券	中国香港	2,154,200	30,341,824.27	1.30

	LTD-H			交易 所				
21	CSR Corporation Ltd.	中国南车	1766 HK	香港 证券 交易 所	中国香 港	4,598,000	27,154,729.08	1.16
22	Dongfeng Motor Group Co. Ltd.	东风集团股份	489 HK	香港 证券 交易 所	中国香 港	3,904,000	26,959,983.97	1.15
23	DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	万达商业	3699 HK	香港 证券 交易 所	中国香 港	650,300	26,455,694.48	1.13
24	China Cinda Asset Management Company Ltd.	中国信达资产管理股份有限公司	1359 HK	香港 证券 交易 所	中国香 港	10,328,900	23,040,560.52	0.99
25	China Railway Group Ltd.	中国中铁	390 HK	香港 证券 交易 所	中国香 港	4,426,000	21,788,751.86	0.93
26	Anhui Conch Cement Co. Ltd.	安徽海螺水泥股份	914 HK	香港 证券 交易 所	中国香 港	1,367,000	21,754,377.04	0.93
27	NEW CHINA LIFE INSURANCE Co. Ltd	新华保险	1336 HK	香港 证券 交易 所	中国香 港	916,100	21,570,635.81	0.92
28	PEOPLES INSURANCE COMPANY(GROUP) OF CHINA LIMITED	中国人民保险集团股份有限公司	1339 HK	香港 证券 交易 所	中国香 港	8,214,000	20,850,170.36	0.89
29	Great Wall Motor Co. Ltd.	长城汽车	2333 HK	香港 证券 交易 所	中国香 港	3,738,000	20,510,336.47	0.88
30	CGN POWER CO LTD-H	中广核电力	1816 HK	香港 证券 交易 所	中国香 港	11,126,000	20,444,475.60	0.87
31	China Longyuan	龙源电	916 HK	香港	中国香	3,513,000	19,275,765.66	0.82

	Power Group Corporation Ltd.	力		证券交易所	港			
32	Huaneng Power International, Inc.	华能国际电力股份	902 HK	香港证券交易所	中国香港	4,684,000	19,135,651.06	0.82
33	GF SECURITIES CO LTD-H	广发证券	1776 HK	香港证券交易所	中国香港	1,265,400	19,034,389.76	0.81
34	BYD Co. Ltd.	比亚迪股份	1211 HK	香港证券交易所	中国香港	476,000	18,896,924.63	0.81
35	CHINA VANKE CO LTD-H	万科	2202 HK	香港证券交易所	中国香港	977,800	12,702,584.16	0.54
36	Air China Ltd.	中国国航	753 HK	香港证券交易所	中国香港	2,272,000	10,291,594.27	0.44
37	China Oilfield Services Ltd.	中海油田服务	2883 HK	香港证券交易所	中国香港	2,004,000	10,190,914.15	0.44
38	China National Building Material Co. Ltd.	中国建材	3323 HK	香港证券交易所	中国香港	3,188,000	9,209,445.30	0.39
39	Tsingtao Brewery Co. Ltd.	青岛啤酒股份	168 HK	香港证券交易所	中国香港	398,000	9,133,260.02	0.39

注：(1) 根据本基金基金合同的约定，本基金为被动式指数基金，投资组合中成份股及备选股投资比例不低于基金资产的90%。(2) 本表所使用的证券代码为彭博代码。

7.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

报告期末，本基金未持有积极投资股票及存托凭证。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%的权益投资明细

金额单位:人民币元

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	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	1398 HK	162,250,502.31	39.37
2	Bank of China Ltd	3988 HK	160,534,248.51	38.95
3	Ping An Insurance (Group) Co. of China Ltd.	2318 HK	151,661,136.76	36.80
4	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	132,416,368.16	32.13
5	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	111,556,561.28	27.07
6	China Life Insurance Co. Ltd.	2628 HK	102,653,336.59	24.91
7	PetroChina Co. Ltd.	857 HK	92,169,469.65	22.36
8	Bank of Communications Co., Ltd.	3328 HK	89,462,790.92	21.71
9	Agricultural Bank of China Ltd.	1288 HK	85,968,698.71	20.86
10	China CITIC Bank Corporation Ltd.	998 HK	78,723,562.01	19.10
11	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	1988 HK	63,157,274.16	15.32
12	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	53,188,982.99	12.91
13	PICC Property and Casualty Co. Ltd.	2328 HK	44,635,193.70	10.83
14	China Telecom Corporation Ltd.	728 HK	39,868,780.87	9.67
15	China Shenhua Energy Co. Ltd.	1088 HK	34,982,600.90	8.49
16	Sinopharm Group Co. Ltd	1099 HK	34,953,037.79	8.48
17	Citic Securities Co.Ltd	6030 HK	31,139,209.80	7.56
18	China Communications Construction Co. Ltd.	1800 HK	30,806,764.25	7.47
19	Haitong Securities Co., Ltd.	6837 HK	27,888,649.84	6.77
20	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	6886 HK	25,534,309.95	6.20

21	Dongfeng Motor Group Co. Ltd.	489 HK	24,792,369.95	6.02
22	CSR Corporation Ltd.	1766 HK	24,014,156.88	5.83
23	DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	3699 HK	23,560,855.69	5.72
24	China Cinda Asset Management Company Ltd.	1359 HK	19,347,863.14	4.69
25	China Railway Group Ltd.	390 HK	18,712,051.26	4.54
26	PEOPLE'S INSURANCE COMPANY (GROUP) OF CHINA LIMITED	1339 HK	18,576,352.15	4.51
27	Anhui Conch Cement Co. Ltd.	914 HK	18,167,581.40	4.41
28	Huaneng Power International, Inc.	902 HK	18,132,713.15	4.40
29	CGN POWER CO LTD-H	1816 HK	18,032,083.01	4.38
30	NEW CHINA LIFE INSURANCE Co. Ltd	1336 HK	17,804,895.38	4.32
31	Great Wall Motor Co. Ltd.	2333 HK	17,315,180.57	4.20
32	GF SECURITIES CO LTD-H	1776 HK	15,178,893.55	3.68
33	China Longyuan Power Group Corporation Ltd.	916 HK	14,916,625.84	3.62
34	BYD Co. Ltd.	1211 HK	14,330,633.94	3.48
35	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	12,017,588.52	2.92
36	China Oilfield Services Ltd.	2883 HK	9,010,382.37	2.19
37	Air China Ltd.	753 HK	8,698,875.58	2.11

7.5.2 累计卖出金额前 20 名的权益投资明细

金额单位:人民币元

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	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	7,819,880.92	1.90
2	Bank of China Ltd	3988 HK	7,757,634.80	1.88
3	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	1398 HK	7,003,616.02	1.70
4	Ping An Insurance (Group) Co. of China Ltd.	2318 HK	6,430,250.82	1.56
5	Bank of Communications	3328 HK	5,069,816.45	1.23

	Co., Ltd.			
6	China Life Insurance Co. Ltd.	2628 HK	4,559,851.63	1.11
7	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	4,439,717.97	1.08
8	China CITIC Bank Corporation Ltd.	998 HK	4,166,065.83	1.01
9	PetroChina Co. Ltd.	857 HK	3,811,670.73	0.92
10	Agricultural Bank of China Ltd.	1288 HK	3,210,392.55	0.78
11	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	1988 HK	3,149,575.74	0.76
12	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	2,339,759.45	0.57
13	China Telecom Corporation Ltd.	728 HK	1,827,094.92	0.44
14	China Shenhua Energy Co. Ltd.	1088 HK	1,445,606.23	0.35
15	PICC Property and Casualty Co. Ltd.	2328 HK	1,358,799.02	0.33
16	China Communications Construction Co. Ltd.	1800 HK	1,316,570.75	0.32
17	Sinopharm Group Co. Ltd	1099 HK	1,311,178.62	0.32
18	Citic Securities Co. Ltd	6030 HK	1,177,488.78	0.29
19	CSR Corporation Ltd.	1766 HK	1,044,862.18	0.25
20	GF SECURITIES CO LTD-H	1776 HK	993,234.48	0.24

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,862,349,874.50
卖出收入（成交）总额	83,427,078.42

注：7.5.1 项“买入金额”、7.5.2 项“卖出金额”及 7.5.3 项“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

7.7 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

报告期末，本基金未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.9 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

报告期末，本基金未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

报告期末，本基金未持有基金。

7.11 投资组合报告附注**7.11.1**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.11.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	45,962,392.43
4	应收利息	40,375.87
5	应收申购款	5,266,062.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	51,268,831.10

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
9,517	377,313.77	3,161,398,713.85	88.04%	429,496,465.66	11.96%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	东方汇智资产—中信银行—安富 1号特定客户资产管理计划	26,459,849.00	6.80%
2	国联证券股份有限公司	22,410,000.00	5.76%
3	兴业证券股份有限公司	20,000,000.00	5.14%
4	南京盛泉恒元投资有限公司—盛 泉恒元量化进取多策略1号基金	14,967,500.00	3.85%
5	齐鲁国际控股有限公司—客户资 金	9,600,000.00	2.47%
6	赵何鉴	9,200,000.00	2.36%
7	新时代信托股份有限公司—新时 代信托·丰金464号证券投资集 合资产管理计划	6,951,614.00	1.79%
8	国信证券股份有限公司	5,750,000.00	1.48%
9	上海大正投资有限公司	5,288,500.00	1.36%
10	宋树	3,333,300.00	0.86%

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 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）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	612,066.75	0.02%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 9 月 30 日）基金份额总额	1, 016, 850, 356. 49
本报告期期初基金份额总额	594, 806, 600. 49
本报告期基金总申购份额	3, 191, 046, 772. 03
减：本报告期基金总赎回份额	194, 958, 193. 01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3, 590, 895, 179. 51

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**（1）基金管理人的重大人事变动情况**

2016 年 1 月 5 日，本基金管理人发布《关于嘉实 H 股指数 (QDII-LOF) 基金经理变更的公告》，杨宇先生不再担任本基金基金经理，聘请何如女士、陈正宪先生担任本基金基金经理职务。

2016 年 1 月 20 日本基金管理人发布公告，戴京焦女士因工作变动不再担任公司副总经理。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券股份有限公司	-	1,454,329,525.40	74.74%	711,770.36	60.38%	新增
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	407,589,490.46	20.95%	407,589.73	34.58%	-
瑞银证券亚洲有限公司 UBS Securities Asia Limited	-	43,086,300.12	2.21%	43,086.36	3.66%	-
高盛（亚洲）有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	40,771,636.94	2.1%	16,308.65	1.38%	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-
德意志证券亚洲有限公司 Deutsche	-	-	-	-	-	-

Securities Asia Limited						
建银国际证券有限公司 CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券(亚太)有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-
农银证券有限公司 CAF Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷(香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
野村国际(香港)有限公司 Nomura International (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-
中国平安证券(香港)有限公司 Ping An of China Securities (Hong Kong) Co. Ltd.	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限公司 BOCI	-	-	-	-	-	-

Securities Limited						
-----------------------	--	--	--	--	--	--

注：基金管理人根据研究服务、交易服务、销售服务、投资策略服务、市场及后台服务等评价指标选择交易券商，并与被选择的交易券商签订协议，通知基金托管人。严格遵守监管规定和与经纪商签订的协议，按照市场惯例确定佣金费率。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实 H 股指数 (QDII-LOF) 基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 1 月 5 日
2	嘉实基金管理有限公司关于嘉实 H 股指数 (QDII-LOF) 暂停大额申购及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 1 月 20 日
3	关于增加陆金所资管及江南农商行为嘉实旗下基金代销机构及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 1 月 25 日
4	关于增加宜信普泽为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 2 月 23 日
5	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与和讯信息科技有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 3 月 18 日
6	嘉实基金管理有限公司关于嘉实 H 股指数 (QDII-LOF) 2016 年 3 月 25 日、3 月 28 日暂停申购赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 3 月 23 日
7	嘉实基金管理有限公司关于嘉实 H 股指数 (QDII-LOF) 恢复大额申购及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 4 月 6 日
8	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金参与中国银河证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 4 月 8 日
9	关于增加上海好买基金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 4 月 18 日
10	关于增加联讯证券为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 5 月 6 日
11	关于增加利得基金为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 5 月 30 日
12	嘉实基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额的数额限制的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 6 月 1 日
13	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金	中国证券报、上海证券报、	2016 年 6 月 14 日

	参与大同证券定投业务的公告	证券时报、管理人网站	
14	嘉实基金管理有限公司关于嘉实 H 股指数 (QDII-LOF) 2016 年 7 月 1 日暂停申购赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 6 月 29 日
15	嘉实基金管理有限公司关于在京东店铺开展费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII - LOF) 募集的文件;
- (2) 《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII - LOF) 基金合同》;
- (3) 《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII - LOF) 招募说明书》;
- (4) 《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII - LOF) 基金托管协议》;
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (6) 报告期内嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII - LOF) 公告的各项原稿。

11.2 存放地点

- (1) 北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司
- (2) 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

11.3 查阅方式

(1) 书面查询: 查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅, 也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询: 基金管理人网址: <http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问, 可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司, 咨询电话 400-600-8800, 或发电子邮件, E-mail: service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2016 年 8 月 27 日