

# 嘉实全球互联网股票型证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	39
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	39
7.4 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.....	40
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	44
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.11 投资组合报告附注.....	46

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.3 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.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	53
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>54</b>
11.1 备查文件目录.....	54
11.2 存放地点.....	54
11.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实全球互联网股票型证券投资基金	
基金简称	嘉实全球互联网股票	
基金主代码	000988	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 15 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,374,940,397.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	嘉实全球互联网股票型证 券投资基金-人民币	嘉实全球互联网股票型证 券投资基金-美元
下属分级基金的交易代码:	000988	000989/000990
报告期末下属分级基金的份额总额	2,298,706,140.57 份	76,234,256.73 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资互联网行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资全球互联网相关行业股票。对于境内投资，本基金采用中观驱动，精选个股的策略，从中观层面分析互联网各子行业发展趋势和景气周期，充分考虑国内互联网企业处于成长初期，跨界和盈利模式创新丰富的特点，挖掘具有广阔成长空间，良好商业模式，独特竞争优势且估值合理的公司；对于境外投资，本基金采用中观驱动，合理对标的策略，从中观层面分析互联网各子行业发展趋势和景气周期，结合各国互联网企业的发展实际情况，充分利用市场的广度和深度，挖掘具有广阔成长空间，良好商业模式，独特竞争优势且估值合理的公司。
业绩比较基准	40%×道琼斯互联网指数+45%×中证海外中国互联网指数+15%×中证全指互联网软件与服务指数
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。同时，本基金为行业基金，在享受全球互联网行业收益的同时，也必须承担单一行业带来的风险。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010) 65215588
		张燕
		(0755) 83199084

	电子邮箱	service@jsfund.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95555
传真		(010) 65182266	(0755) 83195201
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元	深圳深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		北京市建国门北大街8号华润大厦8层	深圳深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100005	518040
法定代表人		邓红国	李建红

## 2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		-

## 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	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
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	嘉实基金管理有限公司	北京市建国门北大街8号华润大厦8层

## § 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

基金级别	嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币	嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元
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)	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)

本期已实现收益	-91,756,110.93	-17,522,015.47
本期利润	-136,162,248.50	-20,534,559.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0572	-0.2710
本期加权平均净值利润率	-6.25%	-4.83%
本期基金份额净值增长率	-5.07%	-7.01%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2016年6月30日)	
期末可供分配利润	-543,945,097.13	-100,109,254.27
期末可供分配基金份额利润	-0.2366	-1.3132
期末基金资产净值	2,280,449,670.00	462,959,044.66
期末基金份额净值	0.992	0.916
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2016年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-0.80%	-8.40%

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;(4) 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币份额以人民币计价并进行申购获得人民币份额;嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元份额以美元计价并进行申购获得美元份额;(5) 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元的期末基金份额净值单位为美元。

## 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

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币

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	1.43%	1.41%	-2.09%	1.33%	3.52%	0.08%
过去三个月	6.55%	1.33%	1.18%	1.06%	5.37%	0.27%
过去六个月	-5.07%	1.92%	-7.43%	1.42%	2.36%	0.50%
过去一年	-3.97%	2.08%	-2.54%	1.61%	-1.43%	0.47%
自基金合同生效起至今	-0.80%	2.23%	3.86%	1.56%	-4.66%	0.67%

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元

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	0.66%	1.45%	-2.09%	1.33%	2.75%	0.12%
过去三个月	3.85%	1.34%	1.18%	1.06%	2.67%	0.28%
过去六个月	-7.01%	1.96%	-7.43%	1.42%	0.42%	0.54%

过去一年	-11.50%	2.10%	-2.54%	1.61%	-8.96%	0.49%
自基金合同生效起至今	-8.40%	2.25%	3.86%	1.56%	-12.26%	0.69%

注：本基金业绩比较基准为：40%×道琼斯互联网指数+45%×中证海外中国互联网指数+15%×中证全指互联网软件与服务指数

基金的业绩基准通常反映本基金主旨是为投资者提供纯粹的分享全球互联网行业发展及成长收益的途径。业绩基准以中国互联网公司（包括在国内与海外上市的股票）和美国互联网公司为核心，充分体现了目前全球互联网行业的特点以及该行业未来发展趋势，可作为该行业市场平均水平的一个衡量。此基准的构成及权重可根据未来全球互联网行业发展态势做出相应的调整从而保持本基金业绩参照物的公平性和时效性。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Benchmark}(0) = 1000$$

$$\text{Return}(t) = 40\% \times (\text{道琼斯互联网指数}(t) / \text{道琼斯互联网指数}(t-1) - 1) + 45\% \times (\text{中证海外中国互联网指数}(t) / \text{中证海外中国互联网指数}(t-1) - 1) + 15\% \times (\text{中证全指互联网软件与服务指数}(t) / \text{中证全指互联网软件与服务指数}(t-1) - 1)$$

$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times \text{Benchmark}(t-1)$$

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

### 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

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币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 1：嘉实全球互联网股票-人民币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

(2015 年 4 月 15 日至 2016 年 6 月 30 日)

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元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 2: 嘉实全球互联网股票-美元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

(2015 年 4 月 15 日至 2016 年 6 月 30 日)

注: 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(十二(二)投资范围和(六)投资限制)的有关约定。

## § 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		
丁杰人	本基金、嘉实策略混合基金经理	2015 年 4 月 15 日	-	9 年	曾任光大证券研究所行业研究员，银河基金管理有限公司研究员、基金经理，2013 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司

					司，现任成长策略组基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。
张丹华	本基金基金经理	2015 年 5 月 15 日	-	5 年	2011 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司研究部任研究员。博士，具有基金从业资格。

注（1）基金经理丁杰人的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理张丹华的任职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、《嘉实全球互联网股票型证券投资基金基金合同》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

国内市场上半年波动下行，存量博弈格局明显，子板块分化较大，新能源汽车、OLED、半导体是持续性较好主线；海外市场方面，美联储加息预期减弱，美国市场基本走平，但是季末英

国脱欧公投超预期，外汇和欧股市场均出现大幅波动；

我们保持了相对稳定的仓位，结构上偏向代表长期方向且估值合理的品种，前瞻性把握了 OLED、半导体、物联网、小间距 LED 等中观机会；海外市场方面，继续配置国内互联网电商、社交和旅游等板块，增加社交和垂直交易平台的配置，同时，综合经济基本面和公司基本面比较，我们也增加了纯美国互联网平台和半导体公司的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实全球互联网股票-人民币基金份额净值为 0.992 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.07%；截至本报告期末嘉实全球互联网股票-美元基金份额净值为 0.916 美元，本报告期基金份额净值增长率为-7.01%；同期业绩比较基准收益率为-7.43%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内市场方面，改革和创新依然是投资主线，市场会回归更加均衡状态，大的分化也给我们精选个股提供了空间，我们将更严格标准选择能够兑现长期增长预期的龙头公司，线索上偏向半导体、物联网、电子新技术、VR、新消费新娱乐等；

海外市场方面，美联储加息预期减弱，市场保持稳定，同时伴随着国内互联网产业层面快速整合和融资端的收紧，龙头公司能够集中更多资源，我们投资也会加以倾斜；纯美股方面，除了云计算、电商、社交等大市值公司外，我们也会适当增加产业层面能够验证的中小市值公司配置。

#### 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验。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，中国证券投资基金业协会，以及香港、纽约证券交易所等。

#### 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) 嘉实全球互联网股票-人民币份额本报告 3.1.1 “本期利润”为 -136,162,248.50 元、3.1.2 “期末可供分配利润”为 -543,945,097.13 元、3.1.2 “期末基金份额净值”为 0.992 元；嘉实全球互联网股票-美元份额本报告 3.1.1 “本期利润”为 -20,534,559.22 元、3.1.2 “期末可供分配利润”为 -100,109,254.27 元、3.1.2 “期末基金份额净值”为 0.916 美元，以及本基金基金合同（十六（三）基金收益分配原则）的约定，报告期内本基金未实施利润分配，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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等信息的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，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：嘉实全球互联网股票型证券投资基金  
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	上年度末
----	-----	-----	------

		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	309,746,278.05	319,890,944.59
结算备付金		794,117.21	3,761,704.55
存出保证金		28,810.18	1,729,736.80
交易性金融资产	6.4.7.2	2,451,042,456.27	2,749,552,831.51
其中：股票投资		2,451,042,456.27	2,749,552,831.51
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		-	11,177,964.71
应收利息	6.4.7.5	28,791.28	39,307.84
应收股利		230,091.92	-
应收申购款		341,194.14	2,710,449.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	11,177,908.23
资产总计		2,762,211,739.05	3,100,040,847.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	32,959,066.23
应付赎回款		13,238,091.44	42,777,008.01
应付管理人报酬		4,015,107.00	4,714,961.35
应付托管费		780,715.26	916,798.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	460,719.20	1,831,877.63
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	308,391.49	11,661,770.21
负债合计		18,803,024.39	94,861,481.48
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,755,245,313.54	2,875,884,851.94
未分配利润	6.4.7.10	-11,836,598.88	129,294,514.55
所有者权益合计		2,743,408,714.66	3,005,179,366.49
负债和所有者权益总计		2,762,211,739.05	3,100,040,847.97

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币份额净值为 0.992 元，基金份额总额 2,298,706,140.57 份；嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元份额净值为 0.916 美元，基金份额总额 76,234,256.73 份。嘉实全球互联网股票型证券投资基金份额总额合计为 2,374,940,397.30 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实全球互联网股票型证券投资基金

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 4 月 15 日(基金合同 生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-125,347,033.28	-180,892,640.12
1.利息收入		544,898.42	1,240,471.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	544,898.42	1,240,471.93
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		-82,697,046.91	34,328,191.76
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-85,431,732.86	29,097,005.55
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	2,734,685.95	5,231,186.21
3.公允价值变动收益	6.4.7.17	-47,418,681.32	-210,840,966.57
4.汇兑收益	6.4.7.21	3,809,338.43	-11,812,461.18
5.其他收入	6.4.7.18	414,458.10	6,192,123.94
<b>减：二、费用</b>		31,349,774.44	28,669,357.95
1. 管理人报酬		23,294,132.02	16,953,077.88
2. 托管费		4,529,414.59	3,296,431.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,732,309.38	8,383,417.13
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	793,918.45	36,431.14
<b>三、利润总额</b>		-156,696,807.72	-209,561,998.07
减：所得税费用		-	-

<b>四、净利润</b>		-156,696,807.72	-209,561,998.07
--------------	--	-----------------	-----------------

注：本基金合同生效日为 2015 年 4 月 15 日，上年度可比期间是指 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 6 月 30 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实全球互联网股票型证券投资基金

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）	2,875,884,851.94	129,294,514.55	3,005,179,366.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-156,696,807.72	-156,696,807.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-120,639,538.40	15,565,694.29	-105,073,844.11
其中：1.基金申购款	98,478,294.23	14,531,517.54	113,009,811.77
2.基金赎回款	-219,117,832.63	1,034,176.75	-218,083,655.88
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）	2,755,245,313.54	-11,836,598.88	2,743,408,714.66
项目	上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日（基金合同生效日）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）	3,530,846,418.57	-	3,530,846,418.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-209,561,998.07	-209,561,998.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	631,963,088.63	345,997,009.00	977,960,097.63
其中：1.基金申购款	1,866,887,034.12	588,620,313.13	2,455,507,347.25

2. 基金赎回款	-1, 234, 923, 945. 49	-242, 623, 304. 13	-1, 477, 547, 249. 62
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)	4, 162, 809, 507. 20	136, 435, 010. 93	4, 299, 244, 518. 13

注：本基金合同生效日为 2015 年 4 月 15 日，上年度可比期间是指 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 6 月 30 日。

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

嘉实全球互联网股票型证券投资基金(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[2014]1440 号《关于准予嘉实全球互联网股票型证券投资基金注册的批复》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》和《嘉实全球互联网股票型证券投资基金基金合同》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人民币 3, 318, 637, 615. 39 元和美元 34, 363, 376. 87 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 243 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《嘉实全球互联网股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 15 日正式生效，基金合同生效日嘉实全球互联网股票人民币份额 3, 320, 056, 116. 98 份和嘉实全球互联网股票美元份额 34, 364, 248. 71 份，其中认购资金利息折合嘉实全球互联网股票人民币份额 1, 418, 501. 59 份和嘉实全球互联网股票美元份额 871. 84 份。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行。

根据《嘉实全球互联网股票型证券投资基金基金合同》和《嘉实全球互联网股票型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购、申购、赎回所使用货币的不同，将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额类别，称为人民币份额；以美元计价并进行认购、申购、赎回的份额类别，称为美元份额。本基金对人民币基金份额和美元基金份额分别设置代码，分别计算基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值。人民币

份额和美元份额合并投资运作，共同承担投资换汇产生的费用。投资者在认购、申购基金份额时可自行选择基金份额类别，并交付相应币种的款项。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实全球互联网股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，具体包括：股票(包含中小板、创业板及其他依法上市的股票)，股指期货、权证，债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括 ETF)；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票市值占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于互联网公司或以互联网为主要依托的公司的比例不低于非现金基金资产的 80%；现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于全球市场，包括境内市场和境外市场，其中主要境外市场有：美国、欧洲、日本和中国香港特别行政区等国家或地区。其中，投资各个市场股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例上限如下：境内市场为 95%，美国为 95%，欧洲为 50%，日本为 50%，中国香港特别行政区为 95%，其他国家或地区为 50%。本基金的业绩比较基准为：40% X 道琼斯互联网指数+45% X 中证海外中国互联网指数+15% X 中证全指互联网软件与服务指数。

#### 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》、《嘉实全球互联网股票型证券投资基金基金合同》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	309,746,278.05
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	309,746,278.05

#### 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	2,136,037,404.43	2,451,042,456.27	315,005,051.84
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	2,136,037,404.43	2,451,042,456.27	315,005,051.84

#### 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	28,420.88

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	357.40
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	13.00
合计	28,791.28

#### 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	460,719.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	460,719.20

#### 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	28,739.21
预提费用	279,652.28
应付指数使用费	-
其他	-
合计	308,391.49

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币		
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	2,433,561,435.28	2,433,561,435.28
本期申购	64,320,209.82	64,320,209.82
本期赎回	-199,175,504.53	-199,175,504.53
本期末	2,298,706,140.57	2,298,706,140.57

金额单位：人民币元

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元		
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	72,130,963.28	442,323,416.66
本期申购	9,861,237.00	34,158,084.41
本期赎回	-5,757,943.55	-19,942,328.10
本期末	76,234,256.73	456,539,172.97

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-483,116,471.87	593,222,218.94	110,105,747.07
本期利润	-91,756,110.93	-44,406,137.57	-136,162,248.50
本期基金份额交易产生的变动数	30,927,485.67	-23,127,454.81	7,800,030.86
其中：基金申购款	-14,133,668.76	7,888,620.67	-6,245,048.09
基金赎回款	45,061,154.43	-31,016,075.48	14,045,078.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-543,945,097.13	525,688,626.56	-18,256,470.57

单位：人民币元

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-88,280,092.41	107,468,859.89	19,188,767.48
本期利润	-17,522,015.47	-3,012,543.75	-20,534,559.22
本期基金份额交易产生的变动数	5,692,853.61	2,072,809.82	7,765,663.43
其中：基金申购款	12,931,428.09	7,845,137.54	20,776,565.63
基金赎回款	-7,238,574.48	-5,772,327.72	-13,010,902.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-100,109,254.27	106,529,125.96	6,419,871.69

**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	526,526.46
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	18,262.59
其他	109.37
合计	544,898.42

**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	1,085,301,499.61
减：卖出股票成本总额	1,170,733,232.47
买卖股票差价收入	-85,431,732.86

**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	2,734,685.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,734,685.95

**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	-47,418,681.32
——股票投资	-47,418,681.32
——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	-47,418,681.32

#### 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	414,458.10
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	414,458.10

#### 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	2,732,309.38
银行间市场交易费用	-
合计	2,732,309.38

#### 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	59,672.34
信息披露费	149,179.94

债券托管账户维护费	-
银行划款手续费	29,050.11
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
存托服务费	556,016.06
其他	-
合计	793,918.45

#### 6.4.7.21 汇兑收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
汇兑收益	3,809,338.43
合计	3,809,338.43

#### 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、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
布朗兄弟哈里曼银行	境外资产托管人
德意志证券亚洲有限公司	与基金管理人股东处于同一控股集团

##### 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****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：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4月15日(基金合同生效日) 至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
德意志证券亚洲有限公司	26,918,009.52	1.34%	63,302,072.36	0.95%

**6.4.10.1.2 债券交易**

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4月15日（基金合同生效日）至2015年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

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4月15日（基金合同生效日）至2015年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 基金交易**

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4月15日（基金合同生效日）至2015年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

**6.4.10.1.5 权证交易**

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4月15日（基金合同生效日）至2015年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
德意志证券亚洲有限公司	26,918.00	1.52%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例

德意志证券亚洲有限公司	63,302.07	1.17%	-	-
-------------	-----------	-------	---	---

注：上述佣金按市场佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 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4月15日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	23,294,132.02	16,953,077.88
其中：支付销售机构的客户维护费	9,418,680.35	6,693,370.57

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 1.8% 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 × 1.8% / 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4月15日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,529,414.59	3,296,431.80

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.35% 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 × 0.35% / 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4月15日（基金合同生效日）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4月15日（基金合同生效日）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 4 月 15 日(基金合同生效日)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
招商银行	195,880,028.95	544,789.05	1,825,420,775.80	1,201,560.15
布朗兄弟哈里曼银行	113,866,249.10		3,563,265.05	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人招商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，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 4 月 15 日（基金合同生效日）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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300046	台基股份	2016 年 3 月 7 日	重大事件停牌	21.96	-	-	3,530,559	84,763,260.95	77,531,075.64	-

			牌							
300353	东土科技	2016年6月23日	重大事件停牌	22.09	-	-	1,193,600	22,145,176.62	26,366,624.00	-

### 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

本基金为主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。同时本基金为行业基金，在享受全球互联网行业收益的同时，也必须承担单一行业带来的风险。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主要投资互联网行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。

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。本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不得超过基金净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。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同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	309,746,278.05	-	309,746,278.05
结算备付金	794,117.21	-	794,117.21
存出保证金	28,810.18	-	28,810.18
交易性金融资产	-	2,451,042,456.27	2,451,042,456.27
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	-	28,791.28	28,791.28
应收股利	-	230,091.92	230,091.92
应收申购款	11,880.37	329,313.77	341,194.14
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	310,581,085.81	2,451,630,653.24	2,762,211,739.05
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	-	13,238,091.44	13,238,091.44
应付管理人报酬	-	4,015,107.00	4,015,107.00
应付托管费	-	780,715.26	780,715.26
应付销售服务费	-	-	-

应付交易费用	-	460,719.20	460,719.20
应交税费	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	-	308,391.49	308,391.49
负债总计	-	18,803,024.39	18,803,024.39
利率敏感度缺口	310,581,085.81	2,432,827,628.85	2,743,408,714.66
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	319,890,944.59	-	319,890,944.59
结算备付金	3,761,704.55	-	3,761,704.55
存出保证金	1,729,736.80	-	1,729,736.80
交易性金融资产	-	2,749,552,831.51	2,749,552,831.51
衍生金融资产	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-
应收证券清算款	-	11,177,964.71	11,177,964.71
应收利息	-	39,307.84	39,307.84
应收股利	-	-	-
应收申购款	27,630.08	2,682,819.66	2,710,449.74
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	-	11,177,908.23	11,177,908.23
资产总计	325,410,016.02	2,774,630,831.95	3,100,040,847.97
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	-	32,959,066.23	32,959,066.23
应付赎回款	-	42,777,008.01	42,777,008.01
应付管理人报酬	-	4,714,961.35	4,714,961.35
应付托管费	-	916,798.05	916,798.05
应付销售服务费	-	-	-
应付交易费用	-	1,831,877.63	1,831,877.63
应交税费	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	-	11,661,770.21	11,661,770.21
负债总计	-	94,861,481.48	94,861,481.48
利率敏感度缺口	325,410,016.02	2,679,769,350.47	3,005,179,366.49

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：无），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	161,055,889.22	-	-	161,055,889.22
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	990,063,426.86	166,364,276.08	-	1,156,427,702.94
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	646.41	-	-	646.41
应收股利	-	230,091.92	-	230,091.92
应收申购款	113,666.19	-	-	113,666.19
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,151,233,628.68	166,594,368.00	-	1,317,827,996.68
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	1,008,679.92	-	-	1,008,679.92
其他负债	2,421.25	-	-	2,421.25
负债合计	1,011,101.17	-	-	1,011,101.17
资产负债表外汇风险敞口净额	1,150,222,527.51	166,594,368.00	-	1,316,816,895.51
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	143,256,356.30	-	-	143,256,356.30

结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	987,674,223.98	253,224,534.35	-	1,240,898,758.33
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	11,177,964.71	-	11,177,964.71
应收利息	341.76	-	-	341.76
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	1,872,273.84	-	-	1,872,273.84
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	11,177,908.23	-	-	11,177,908.23
资产合计	1,143,981,104.11	264,402,499.06	-	1,408,383,603.17
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	1,552,604.50	-	-	1,552,604.50
其他负债	3,997.07	11,177,964.71	-	11,181,961.78
负债合计	1,556,601.57	11,177,964.71	-	12,734,566.28
资产负债表外汇风险敞口净额	1,142,424,502.54	253,224,534.35	-	1,395,649,036.89

#### 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%	65,840,844.78	69,782,451.84
	所有外币相对人民币 贬值 5%	-65,840,844.78	-69,782,451.84

#### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单

个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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	2,451,042,456.27	89.34	2,749,552,831.51	91.49
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	2,451,042,456.27	89.34	2,749,552,831.51	91.49

#### 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%	140,051,014.90	-
	业绩比较基准下降5%	-140,051,014.90	-

注：于2015年12月31日，本基金成立未滿一年，尚无足够经验数据。

#### 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 2,347,144,756.63 元，属于第二层次的余额为 103,897,699.64 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 2,600,390,992.81 元，第二层次 149,161,838.70 元，无属于第三层次的余额）。

###### (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	2,451,042,456.27	88.73
	其中:普通股	1,790,914,759.41	64.84
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	660,127,696.86	23.90
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	310,540,395.26	11.24
8	其他各项资产	628,887.52	0.02
	合计	2,762,211,739.05	100.00

### 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 (%)
美国	990,063,426.86	36.09
中国	1,294,614,753.33	47.19
中国香港	166,364,276.08	6.06
合计	2,451,042,456.27	89.34

### 7.3 期末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	478,622,071.56	17.45
工业	76,995,051.00	2.81
信息技术	1,835,048,591.46	66.89
原材料	60,376,742.25	2.20
合计	2,451,042,456.27	89.34

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。

#### 7.4 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

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	Sino Wealth Electronic Ltd	中颖电子	300327 CH	深圳证券交易所	中国	4,500,000	240,435,000.00	8.76
2	Lattice Semiconductor Corp	-	LSCC UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,208,104	184,767,488.96	6.73
3	Unilumin Group Co Ltd	洲明科技	300232 CH	深圳证券交易所	中国	10,343,792	163,949,103.20	5.98
4	BITAUTO HOLDINGS LTD-ADR	-	BITA UN	纽约证券交易所	美国	800,000	143,021,721.60	5.21
5	Hangzhou Everfine Photo E Info	远方光电	300306 CH	深圳证券交易所	中国	5,500,936	130,537,211.28	4.76
6	Tencent Holdings Ltd.	腾讯控股	700 HK	香港证券交易所	中国香港	802,300	120,752,076.59	4.40
7	CTRIP.COM INTERNATIONAL LTD	Ctrip.com 国际有限公司	CTRP UW	纳斯达克证券交易所	美国	400,000	109,282,176.00	3.98

				所				
8	Facebook Inc	-	FB UW	纳斯达克 证券 交易 所	美国	130,000	98,515,759.68	3.59
9	Hangzhou Shunwang Technology C	顺网科技	300113 CH	深圳 证券 交易 所	中国	2,492,114	94,600,647.44	3.45
10	Weibo Corp	-	WB UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	500,000	94,196,196.00	3.43
11	Kaiser China Holding Co Ltd	凯撒股份	002425 CH	深圳 证 券 交 易 所	中国	4,239,300	93,264,600.00	3.40
12	NSFOCUS Information Technology	绿盟科技	300369 CH	深圳 证 券 交 易 所	中国	2,185,606	92,472,989.86	3.37
13	JD.COM INC-ADR	-	JD UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	607,930	85,584,613.98	3.12
14	Hubei Tech Semiconductors Co L	台基股份	300046 CH	深圳 证 券 交 易 所	中国	3,530,559	77,531,075.64	2.83
15	Youngy Co Ltd	*ST 路翔	002192 CH	深圳 证 券 交 易 所	中国	1,979,380	73,138,091.00	2.67
16	Amazon.com Inc	-	AMZN UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	15,000	71,181,290.16	2.59
17	Wangsu Science & Technology Co	网宿科技	300017 CH	深圳 证 券 交 易 所	中国	926,963	62,291,913.60	2.27

18	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	-	BABA UN	纽约证券交易所	美国	100,000	52,737,933.60	1.92
19	Alphabet Inc	-	GOOGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,000	46,652,481.36	1.70
20	Advanced Technology & Material	安泰科技	000969 CH	深圳证券交易所	中国	3,000,000	42,090,000.00	1.53
21	Global Infotech Co Ltd	高伟达	300465 CH	深圳证券交易所	中国	552,901	41,544,981.14	1.51
22	AirMedia Group Inc	-	AMCN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,500,000	34,117,524.00	1.24
23	Shenzhen Tianyuan Dic Informat	天源迪科	300047 CH	深圳证券交易所	中国	1,700,000	33,915,000.00	1.24
24	Tesla Motors Inc	-	TSLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	20,000	28,153,422.72	1.03
25	COGOBUY GROUP	科通芯城	400 HK	香港证券交易所	中国香港	2,645,000	28,076,678.70	1.02
26	Kyland Technology Co Ltd	东土科技	300353 CH	深圳证券交易所	中国	1,193,600	26,366,624.00	0.96
27	Leshi Internet Information & T	乐视网	300104 CH	深圳证券交易所	中国	399,972	21,162,518.52	0.77
28	TAL Education Group	-	XRS UN	纽约证券	美国	50,000	20,576,613.60	0.75

				交易所				
29	Jiangsu Nata Opto-electronic M	南大光电	300346 CH	深圳证券交易所	中国	408,825	18,286,742.25	0.67
30	Beijing Tongtech Co Ltd	东方通	300379 CH	深圳证券交易所	中国	229,943	18,275,869.64	0.67
31	TravelSky Technology Ltd.	中国民航信息网络	696 HK	香港证券交易所	中国香港	1,377,000	17,535,520.79	0.64
32	SVG Optronics Co Ltd	苏大维格	300331 CH	深圳证券交易所	中国	499,987	14,254,629.37	0.52
33	CHINACACHE INTERNAT-SPON ADR	-	CCIH UW	纳斯达克证券交易所	美国	300,000	12,891,052.80	0.47
34	Wisefsoft Co Ltd	川大智胜	002253 CH	深圳证券交易所	中国	299,893	11,201,003.55	0.41
35	Guangdong Qtone Education Co L	全通教育	300359 CH	深圳证券交易所	中国	345,282	10,241,064.12	0.37
36	TUNIUI CORP-SPON ADR	-	TOUR UQ	纳斯达克证券交易所	美国	150,000	8,385,152.40	0.31
37	Henan Hanwei Electronics Co Lt	汉威电子	300007 CH	深圳证券交易所	中国	300,000	8,376,000.00	0.31
38	Beijing Interact Technology Co	浩丰科技	300419 CH	深圳证券交易所	中国	136,553	5,766,633.19	0.21
39	Shanghai	上海新阳	300236	深圳	中国	100,000	5,059,000.00	0.18

	Sinyang Semiconductor		CH	证券交易所				
40	Zhejiang Wanliyang Co Ltd	万里扬	002434 CH	深圳证券交易所	中国	354,500	3,856,960.00	0.14
41	Toyot Feiji Electronics Co Ltd	同有科技	300302 CH	深圳证券交易所	中国	112,665	3,658,232.55	0.13
42	Leaguer Stock Co Ltd	力合股份	000532 CH	深圳证券交易所	中国	72,100	1,309,336.00	0.05
43	Sichuan Troy Information Techn	创意信息	300366 CH	深圳证券交易所	中国	27,193	1,029,526.98	0.04

注：本表所使用的境外证券代码为彭博代码。

## 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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Hangzhou Everfine Photo E Info	300306	117,409,274.45	3.91
2	BITAUTO HOLDINGS LTD-ADR	BITA UN	102,383,570.72	3.41
3	Weibo Corp	WB UW	77,887,064.34	2.59
4	Lattice Semiconductor Corp	LSCC UW	67,658,931.65	2.25
5	Sino Wealth Electronic Ltd	300327	62,962,029.07	2.10
6	Alphabet Inc	GOOGL UW	61,641,542.77	2.05
7	Hithink RoyalFlush Information Network Co., Ltd.	300033	39,717,984.84	1.32
8	Advanced Technology & Material	000969	39,156,091.96	1.30
9	Hubei Tech Semiconductors Co L	300046	38,648,782.67	1.29
10	Facebook Inc	FB UW	33,334,416.90	1.11

11	Tesla Motors Inc	TSLA UW	29,157,833.65	0.97
12	Kyland Technology Co Ltd	300353	22,145,176.62	0.74
13	Tencent Holdings Ltd.	700 HK	18,152,851.73	0.60
14	TAL Education Group	XRS UN	16,060,927.90	0.53
15	Jiangsu Nata Opto-electronic M	300346	15,856,623.53	0.53
16	LANZHOU SANMAO INDUSTRIAL CO.,LTD.	000779	15,518,039.48	0.52
17	Global Infotech Co Ltd	300465	14,997,158.32	0.50
18	SVG Optronics Co Ltd	300331	14,950,578.73	0.50
19	Kaiser China Holding Co Ltd	002425	12,980,099.92	0.43
20	Shenzhen Tianyuan Dic Informat	300047	12,512,491.00	0.42

### 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	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA UN	108,128,359.07	3.60
2	Oriental Times Media Corporation	002175	87,951,977.67	2.93
3	Sino Wealth Electronic Ltd	300327	76,598,330.23	2.55
4	Hangzhou Shunwang Technology C	300113	61,641,721.07	2.05
5	Alphabet Inc	GOOGL UW	57,065,617.91	1.90
6	NETFLIX INC	NFLX UW	42,819,134.88	1.42
7	NETDRAGON WEBSOFT IN	777 HK	39,668,838.70	1.32
8	Hithink RoyalFlush Information Network Co., Ltd.	300033	38,351,993.96	1.28
9	Henan Tong-Da Cable Co., Ltd.	002560	33,747,780.49	1.12
10	TravelSky Technology Ltd.	696 HK	32,974,647.54	1.10
11	Jiangsu Changjiang Electronics Technology Co.,Ltd.	600584	32,408,958.69	1.08
12	Hangzhou Huaxing Chuangye Communication Technology Co.,Ltd.	300025	27,395,823.18	0.91

13	Wisefsoft Co.,Ltd.	WUBA UN	27,110,674.03	0.90
14	Wisefsoft Co Ltd	002253	26,718,132.40	0.89
15	JD.COM INC-ADR	JD UW	26,122,180.52	0.87
16	Shandong Ruifeng Chemical Co., Ltd.	300243	23,136,452.17	0.77
17	Beijing Interact Technology Co	300419	22,146,750.81	0.74
18	Stellar Megaunion Corporation	000892	20,536,049.42	0.68
19	Xiamen Red Phase Instruments INC.	300427	19,528,007.16	0.65
20	HC INTERNATIONAL INC	2280 HK	18,774,910.11	0.62

### 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	919,641,538.55
卖出收入（成交）总额	1,085,301,499.61

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	28,810.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	230,091.92
4	应收利息	28,791.28
5	应收申购款	341,194.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	628,887.52

## 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

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

# § 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

份额级别	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
嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币	47,945	47,944.65	-	-	2,298,706,140.57	100.00%
嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元	3,833	19,888.93	-	-	76,234,256.73	100.00%
合计	51,778	45,867.75	-	-	2,374,940,397.30	100.00%

注：(1) 嘉实全球互联网股票-人民币：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占

总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实全球互联网股票-人民币份额占嘉实全球互联网股票-人民币总份额比例、个人投资者持有嘉实全球互联网股票-人民币份额占嘉实全球互联网股票-人民币总份额比例；

(2) 嘉实全球互联网股票-美元: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实全球互联网股票-美元份额占嘉实全球互联网股票-美元总份额比例、个人投资者持有嘉实全球互联网股票-美元份额占嘉实全球互联网股票-美元总份额比例。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币	1,468,772.33	0.06%
	嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元	-	0.00%
	合计	1,468,772.33	0.06%

## 8.3 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	份额级别	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	嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币	50~100
	嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元	0
		50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币	10~50
	嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元	0

	合计	10~50
--	----	-------

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实全球互联网 股票型证券投资 基金-人民币	嘉实全球互联网 股票型证券投资 基金-美元
基金合同生效日（2015 年 4 月 15 日）基金份 额总额	3,320,056,116.98	34,364,248.71
本报告期期初基金份额总额	2,433,561,435.28	72,130,963.28
本报告期基金总申购份额	64,320,209.82	9,861,237.00
减：本报告期基金总赎回份额	199,175,504.53	5,757,943.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	2,298,706,140.57	76,234,256.73

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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 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

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

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、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**

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**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	
中信证券股份有限公司 Citic Securities Company Limited	-	1,117,413,387.81	55.73%	782,197.16	44.18%	-
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	233,786,032.50	11.66%	375,864.47	21.23%	新增
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	181,788,643.69	9.07%	100,142.67	5.66%	-
瑞银证券亚洲有限公司 UBS Securities Asia Limited	-	102,136,217.10	5.09%	86,441.00	4.88%	-
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	-	94,175,995.01	4.70%	65,923.16	3.72%	-
Oppenheimer Europe Ltd.	-	84,289,049.83	4.20%	61,264.85	3.46%	-
里昂证券有限公	-	55,882,565.25	2.79%	44,304.67	2.50%	-

司 CLSA Limited						
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	47,851,870.56	2.39%	89,385.12	5.05%	-
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	33,040,014.75	1.65%	108,130.80	6.11%	-
德意志证券亚洲有限公司 Deutsche Securities Asia Limited	-	26,918,009.52	1.34%	26,918.00	1.52%	-
中信建投（国际）证券有限公司 China Securities (International) Brokerage Company Limited	-	13,475,298.97	0.67%	12,127.77	0.69%	-
野村国际（香港）有限公司 Nomura International (Hong Kong) Limited	-	11,730,720.02	0.59%	14,076.86	0.80%	新增
大和资本市场香港有限公司 Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	-	1,582,806.79	0.08%	2,374.21	0.13%	新增
工银国际证券有限公司 ICBC International Securities Limited	-	872,426.36	0.04%	1,308.64	0.07%	-
国泰君安证券股份有限公司 Guotai Junan Securities Co. Ltd.	-	-	-	-	-	-
建银国际证券有限公司 CCB	-	-	-	-	-	-

International Securities Limited						
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited						-
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C						-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited						-
法国巴黎证券(亚洲)有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited						-
中国光大证券(香港)有限公司 China Everbright Securities (HK) Limited						-
渤海证券股份有限公司						-
广发证券(香港)经济有限公司 GF Securities (Hong Kong) Brokerage Ltd						-
中国银河证券股份有限公司 China Galaxy International Financials Holdings						-

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	嘉实基金管理有限公司关于嘉实全球互联网股票(QDII)2016年1月18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1月14日
2	关于增加中信银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016年1月27日
3	嘉实基金管理有限公司关于嘉实全球互联网股票(QDII)2016年2月15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2月2日
4	关于增加福建海峡银行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24日
5	关于增加诺亚正行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3月16日
6	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
7	嘉实基金管理有限公司关于嘉实全球互联网股票(QDII)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
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
10	嘉实基金管理有限公司关于嘉实全球互联网股票(QDII)2016年5月30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5月26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	关于增加徽商银行作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6月1日
13	关于增加中正达广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6月8日
14	嘉实基金管理有限公司关于嘉实全球互联网股票(QDII)2016年7	中国证券报、上海证券报、证券时报、管	2016年6月29日

	月 1 日、7 月 4 日暂停申购赎回业务的公告	理人网站	
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) 中国证监会核准嘉实全球互联网股票型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实全球互联网股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实全球互联网股票型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实全球互联网股票型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实全球互联网股票型证券投资基金公告的各项原稿。

### 11.2 存放地点

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

### 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