

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF) 2020 年中期报告

2020 年 06 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：2020 年 08 月 29 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。本中期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 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 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.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	12
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.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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 托管人对本中期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.....	17
§ 7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	36
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	36
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.....	37
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	42

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	44
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.....	44
7.11 投资组合报告附注.....	44
§ 8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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情况.....	46
§ 9 开放式基金份额变动.....	46
§ 10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	51
§ 12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 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	338,786,284.23 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%,以实现对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	李申
	联系电话	(010)65215588	021-60637102
	电子邮箱	service@jsfund.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	021-60637111
传真		(010)65215588	021-60635778
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 27 楼 09-14 单元	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 21 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1

	北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	号楼
邮政编码	100005	100033
法定代表人	经雷	田国立

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	美国道富银行
	英文	State Street Bank and Trust Company
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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 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(2020 年 01 月 01 日-2020 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	5,505,656.92
本期利润	-11,361,115.41
加权平均基金份额本期利润	-0.0372
本期加权平均净值利润率	-4.65%
本期基金份额净值增长率	-10.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	-72,871,227.98
期末可供分配基金份额利润	-0.2151
期末基金资产净值	265,915,056.25
期末基金份额净值	0.7849
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-21.51%

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）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。

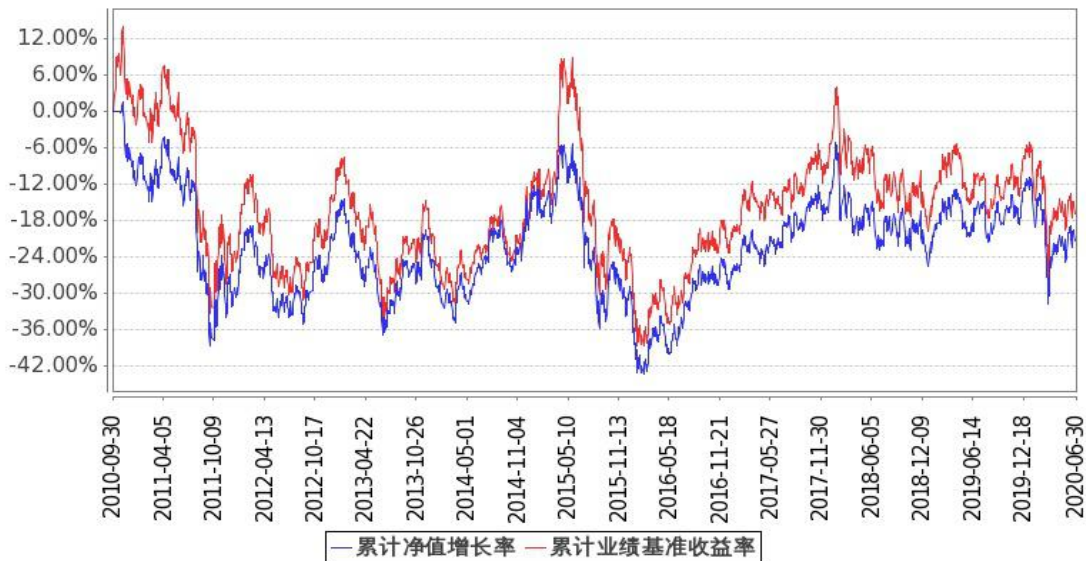
3.2 基金净值表现

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	2.20%	1.19%	1.35%	1.21%	0.85%	-0.02%
过去三个月	3.30%	1.31%	1.68%	1.35%	1.62%	-0.04%
过去六个月	-10.61%	1.81%	-10.90%	1.89%	0.29%	-0.08%
过去一年	-6.47%	1.40%	-6.88%	1.46%	0.41%	-0.06%
过去三年	1.33%	1.23%	-0.91%	1.31%	2.24%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-21.51%	1.34%	-16.88%	1.43%	-4.63%	-0.09%

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) 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 2020 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（十四（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，在北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。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 2020 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 190 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、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 300ETF 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 (QDII) 混合、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)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数

(QDII)、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 400ETF 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、嘉实对冲套利定期混合、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、嘉实 3 个月理财债券 A/E、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、嘉实快线货币、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、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合 (LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油 (QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合 (FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合 (FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合 (FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉

实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合 (FOF)、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开行指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接 A/C、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,基金管理人还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		
高峰	本基金、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实创业板 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实先进制造 100ETF、嘉实医药健康 100ETF 基金经理	2019 年 4 月 2 日		5 年	曾任中国工商银行股份有限公司金融市场部外汇及衍生品交易员。2015 年加入嘉实基金管理有限公司任指数投资部指数研究员,现任指数投资部基金经理。北京大学金融学硕士,特许金融分析师 (CFA),具有基金从业资格。
何如	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实基本面 50ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实	2016 年 1 月 5 日		14 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

	沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实中证 500 成长估值 ETF 基金经理				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、基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，加拿大籍。
--	--	--	--	--	---

注：（1）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、《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII - L0F）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，本基金日均跟踪误差为 0.14%，年化跟踪误差为 2.26%，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 0.7849 元；本报告期基金份额净值增长率为-10.61%，业绩比较基准收益率为-10.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金跟踪的恒生中国企业指数成份股均为在香港上市交易的内地公司，企业盈利增速的变化跟随国内经济周期的趋势；但市场交易主体主要由欧美等海外资金构成，流动性受欧美等发达经济体的直接影响较大。

本基金作为一只投资于恒生中国企业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恒生中国企业指数的投资工具，为投资者分享中国经济的未来成长提供良好的投资机会。

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但不限于上海、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 3.1.1 “本期利润”为-11,361,115.41 元，3.1.2 “期末可供分配利润”为-72,871,227.98 元，以及本基金基金合同（十九(三)基金收益分配原则）相关条款的约定，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遵规守信、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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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：2020年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	12,492,867.00	12,842,967.30
结算备付金		27,777.78	111,904.76
存出保证金		-	337.42
交易性金融资产	6.4.7.2	252,988,322.89	224,510,456.33
其中：股票投资		250,987,322.89	224,510,456.33
基金投资		-	-
债券投资		2,001,000.00	-
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		-	1,336,839.76
应收利息	6.4.7.5	22,742.74	2,351.88
应收股利		3,336,387.02	33,078.93

应收申购款		944,388.68	496,143.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		269,812,486.11	239,334,079.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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		15.91	32.39
应付赎回款		3,491,877.85	1,911,096.01
应付管理人报酬		166,714.83	148,610.91
应付托管费		55,571.62	49,536.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	20,409.65	6,442.06
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	162,840.00	219,122.64
负债合计		3,897,429.86	2,334,840.98
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	338,786,284.23	269,889,733.44
未分配利润	6.4.7.10	-72,871,227.98	-32,890,494.96
所有者权益合计		265,915,056.25	236,999,238.48
负债和所有者权益总计		269,812,486.11	239,334,079.46

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7849 元，基金份额总额 338,786,284.23 份。

6.2 利润表

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：2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-9,459,544.04	28,867,719.65
1. 利息收入		60,637.88	35,257.70
其中：存款利息收入	6.4.7.11	49,372.61	35,257.70
债券利息收入		1,682.87	-
资产支持证券利息收		-	-

入			
买入返售金融资产收入		9,582.40	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		7,657,365.08	11,147,911.78
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	2,621,948.47	6,160,406.65
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	5,035,416.61	4,987,505.13
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-16,866,772.33	18,010,287.58
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.21	-409,164.69	-412,318.55
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	98,390.02	86,581.14
减: 二、费用		1,901,571.37	1,961,423.44
1. 管理人报酬		912,044.94	949,032.40
2. 托管费		304,015.02	316,344.14
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	509,026.15	514,652.13
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	176,485.26	181,394.77
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-11,361,115.41	26,906,296.21
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-11,361,115.41	26,906,296.21

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: 2020年1月1日至2020年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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)	269,889,733.44	-32,890,494.96	236,999,238.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-11,361,115.41	-11,361,115.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	68,896,550.79	-28,619,617.61	40,276,933.18
其中：1. 基金申购款	220,613,405.96	-57,088,122.70	163,525,283.26
2. 基金赎回款	-151,716,855.17	28,468,505.09	-123,248,350.08
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	338,786,284.23	-72,871,227.98	265,915,056.25
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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)	380,349,167.29	-88,787,710.05	291,561,457.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	26,906,296.21	26,906,296.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-115,395,540.65	19,265,077.75	-96,130,462.90
其中：1. 基金申购款	20,162,946.71	-3,515,204.25	16,647,742.46
2. 基金赎回款	-135,558,487.36	22,780,282.00	-112,778,205.36

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	264,953,626.64	-42,616,336.09	222,337,290.55

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：

经雷

罗丽丽

罗丽丽

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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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×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<年度报告和中期报告>》、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[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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政策的补充通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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) 对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利,H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册,H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利,由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 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。

(5) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	12,492,867.00
定期存款	—
其中:存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月及以上	—
其他存款	—

合计	12,492,867.00
----	---------------

注:定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	246,706,291.04	250,987,322.89	4,281,031.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,002,710.00	-1,710.00
	银行间市场	-	-
	合计	2,002,710.00	-1,710.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	248,709,001.04	252,988,322.89	4,279,321.85

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,396.60
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	12.50
应收债券利息	21,328.77
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	4.87
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-

合计	22,742.74
----	-----------

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	20,409.65
银行间市场应付交易费用	—
合计	20,409.65

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	11,817.55
应付证券出借违约金	—
预提费用	124,316.92
应付指数使用费	26,705.53
合计	162,840.00

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	269,889,733.44	269,889,733.44
本期申购	220,613,405.96	220,613,405.96
本期赎回（以“-”号填列）	-151,716,855.17	-151,716,855.17
本期末	338,786,284.23	338,786,284.23

6.4.7.10 未分配利润

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	-58,756,828.90	25,866,333.94	-32,890,494.96
本期利润	5,505,656.92	-16,866,772.33	-11,361,115.41
本期基金份额交易产生的变动数	-14,657,449.99	-13,962,167.62	-28,619,617.61
其中：基金申购款	-47,205,700.85	-9,882,421.85	-57,088,122.70
基金赎回款	32,548,250.86	-4,079,745.77	28,468,505.09
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-67,908,621.97	-4,962,606.01	-72,871,227.98

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	39,086.60
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	6,312.97
其他	3,973.04
合计	49,372.61

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	82,868,249.24
减：卖出股票成本总额	80,246,300.77
买卖股票差价收入	2,621,948.47

6.4.7.13 基金投资收益

无。

6.4.7.14 债券投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,035,416.61
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,035,416.61

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-16,866,772.33
股票投资	-16,865,062.33

债券投资	-1,710.00
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	-
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值 税	-
合计	-16,866,772.33

6.4.7.18 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	98,390.02
合计	98,390.02

6.4.7.19 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	508,825.87
银行间市场交易费用	200.28
合计	509,026.15

6.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,526.00
上市年费	29,835.26
指数使用费	48,642.34
合计	176,485.26

6.4.7.21 汇兑收益

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
----	--

汇兑收益	-409,164.69
合计	-409,164.69

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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	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

无。

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	912,044.94	949,032.40
其中：支付销售机构的客户维护费	190,168.04	191,204.37

注：1. 支付基金管理人的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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	304,015.02	316,344.14

注：支付基金托管人中国建设银行的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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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

无。

6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019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
中国建设银行股份有限公司_活期	6,952,221.66	39,016.42	8,068,152.72	34,664.34
美国道富银行_活期	5,540,645.34	70.18	3,436,578.83	289.83

注：本基金的活期银行存款分别由基金托管人和境外资产托管人保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.11 利润分配情况

本期 (2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末 (2020 年 06 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**

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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**

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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。 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同责任，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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、资产支持证券投资、同业存单投资(上年度末：本基金未持有债券投资、资产支持证券投资、同业存单投资)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,492,867.00	-	-	-	12,492,867.00
结算备付金	27,777.78	-	-	-	27,777.78
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	2,001,000.00	-	-	250,987,322.89	252,988,322.89
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	-	-	-	22,742.74	22,742.74
应收股利	-	-	-	3,336,387.02	3,336,387.02
应收申购款	69,481.79	-	-	874,906.89	944,388.68
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,591,126.57	-	-	255,221,359.54	269,812,486.11
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	-	-	-	15.91	15.91
应付赎回款	-	-	-	3,491,877.85	3,491,877.85
应付管理人报酬	-	-	-	166,714.83	166,714.83
应付托管费	-	-	-	55,571.62	55,571.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	20,409.65	20,409.65
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	162,840.00	162,840.00
负债总计	-	-	-	3,897,429.86	3,897,429.86
利率敏感度缺口	14,591,126.57	-	-	251,323,929.68	265,915,056.25
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,842,967.30	-	-	-	12,842,967.30

结算备付金	111,904.76	-	-	-	111,904.76
存出保证金	337.42	-	-	-	337.42
交易性金融资产	-	-	-	224,510,456.33	224,510,456.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,336,839.76	1,336,839.76
应收利息	-	-	-	2,351.88	2,351.88
应收股利	-	-	-	33,078.93	33,078.93
应收申购款	13,227.25	-	-	482,915.83	496,143.08
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,968,436.73	-	-	226,365,642.73	239,334,079.46
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	-	-	-	32.39	32.39
应付赎回款	-	-	-	1,911,096.01	1,911,096.01
应付管理人报酬	-	-	-	148,610.91	148,610.91
应付托管费	-	-	-	49,536.97	49,536.97
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	6,442.06	6,442.06
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	219,122.64	219,122.64
负债总计	-	-	-	2,334,840.98	2,334,840.98
利率敏感度缺口	12,968,436.73	-	-	224,030,801.75	236,999,238.48

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 2020 年 6 月 30 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.75%(2019 年 12 月 31 日,本基金未持有交易性债券投资),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 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 2020 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	5,541,097.61	-	5,541,097.61
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	250,987,322.89	-	250,987,322.89
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	796,105.88	-	796,105.88
应收利息	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	257,324,526.38	-	257,324,526.38
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	257,324,526.38	-	257,324,526.38
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			

	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	3,773,724.15	-	3,773,724.15
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	224,510,456.33	-	224,510,456.33
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	48.31	-	48.31
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	1,336,839.76	-	1,336,839.76
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	229,621,068.55	-	229,621,068.55
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	229,621,068.55	-	229,621,068.55

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		
	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 (2020 年 6 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
分析	所有外币相对人民币 升值 5%	12,866,226.32	11,481,053.43

所有外币相对人民币 贬值 5%	-12,866,226.32	-11,481,053.43
--------------------	----------------	----------------

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 2020年6月30日		上年度末 2019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	250,987,322.89	94.39	224,510,456.33	94.73
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	250,987,322.89	94.39	224,510,456.33	94.73

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	
	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 (2020 年 6 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	12,686,563.49	11,232,212.00
	业绩比较基准下降 5%	-12,686,563.49	-11,232,212.00

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 250,987,322.89 元，属于第二层次的余额为 2,001,000.00 元，无属于第三层次的余额(上年度末：第一层次 224,510,456.33 元，无属于第二层次的余额，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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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	250,987,322.89	93.02
	其中:普通股	250,987,322.89	93.02
	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	2,001,000.00	0.74
	其中:债券	2,001,000.00	0.74
	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	12,520,644.78	4.64
8	其他各项资产	4,303,518.44	1.60
9	合计	269,812,486.11	100.00

注:通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 130,073.86 元,占基金资产净值的比例为 0.05%;
通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 72,432,710.02 元,占基金资产净值的比例为 27.24%。

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	250,987,322.89	94.39
合计	250,987,322.89	94.39

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(%)
通信服务	54,704,944.21	20.57
非必需消费品	14,153,775.64	5.32
必需消费品	12,572,770.83	4.73
能源	18,098,414.21	6.81
金融	91,279,529.27	34.33
医疗保健	12,091,556.04	4.55
工业	7,413,433.38	2.79
信息技术	4,881,788.73	1.84
原材料	3,552,276.82	1.34
房地产	21,659,810.13	8.15
公用事业	10,579,023.63	3.98
合计	250,987,322.89	94.39

注:本基金持有的权益投资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

无。

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

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	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港证券交易所	中国香港	67,200	30,605,647.56	11.51
2	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	335,000	23,715,186.00	8.92
3	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	工商银行	1398 HK	香港证券交易所	中国香港	4,458,000	19,138,942.94	7.20
4	China Mobile Ltd	中国移动	941 HK	香港证券交易所	中国香港	371,500	17,747,636.80	6.67
5	Bank of China Ltd	中国银行	3988 HK	香港证券	中国香港	4,801,000	12,586,171.01	4.73

				交易所				
6	CNOOC Ltd	中国海洋石油	883 HK	香港证券交易所	中国香港	1,080,000	8,503,761.02	3.20
7	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行	3968 HK	香港证券交易所	中国香港	235,850	7,680,251.48	2.89
8	China Life Insurance Co Ltd	中国人寿	2628 HK	香港证券交易所	中国香港	450,000	6,412,348.80	2.41
9	Sino Biopharmaceutical Ltd	中国生物制药	1177 HK	香港证券交易所	中国香港	457,000	6,094,654.36	2.29
10	China Resources Land Ltd	华润置地	1109 HK	香港证券交易所	中国香港	194,000	5,201,036.02	1.96
11	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	舜宇光学科技	2382 HK	香港证券交易所	中国香港	43,100	4,881,788.73	1.84
12	Agricultural Bank of China Ltd	农业银行	1288 HK	香港证券交易所	中国香港	1,672,000	4,765,087.64	1.79
13	Sunac China Holdings Ltd	融创中国	1918 HK	香港证券交易所	中国香港	154,000	4,564,733.71	1.72
14	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	石药集团	1093 HK	香港证券交易所	中国香港	338,400	4,525,342.53	1.70
15	China Mengniu Dairy Co Ltd	蒙牛乳业	2319 HK	香港证券交易所	中国香港	167,000	4,515,316.60	1.70
16	China Petroleum & Chemical Corp	中国石化	386 HK	香港证券交易所	中国香港	1,465,600	4,324,122.65	1.63

				交易所				
17	Shenzhou International Group Holdings Ltd	申洲国际	2313 HK	香港证券交易所	中国香港	50,000	4,265,764.80	1.60
18	ANTA Sports Products Ltd	安踏体育	2020 HK	香港证券交易所	中国香港	65,000	4,061,154.24	1.53
19	Country Garden Holdings Co Ltd	碧桂园	2007 HK	香港证券交易所	中国香港	463,112	4,027,198.24	1.51
20	China Resources Beer Holdings Co Ltd	华润啤酒	291 HK	香港证券交易所	中国香港	98,000	3,867,139.58	1.45
21	ENN Energy Holdings Ltd	新奥能源	2688 HK	香港证券交易所	中国香港	47,700	3,799,398.87	1.43
22	Geely Automobile Holdings Ltd	吉利汽车	175 HK	香港证券交易所	中国香港	334,000	3,722,085.31	1.40
23	Longfor Group Holdings Ltd	龙湖集团	960 HK	香港证券交易所	中国香港	108,500	3,652,138.65	1.37
24	Anhui Conch Cement Co Ltd	海螺水泥	914 HK	香港证券交易所	中国香港	74,500	3,552,276.82	1.34
25	China Tower Corp Ltd	中国铁塔	788 HK	香港证券交易所	中国香港	2,680,000	3,353,786.31	1.26
26	China Pacific Insurance Group Co Ltd	中国太保	2601 HK	香港证券交易所	中国香港	167,800	3,172,797.30	1.19
27	China Conch Venture Holdings Ltd	海螺创业	586 HK	香港证券交易所	中国香港	103,500	3,091,492.01	1.16

				交易所				
28	PetroChina Co Ltd	中国石油	857 HK	香港证券交易所	中国香港	1,276,000	2,995,462.07	1.13
29	CITIC Ltd	中信股份	267 HK	香港证券交易所	中国香港	440,000	2,925,931.01	1.10
30	China Gas Holdings Ltd	中国燃气	384 HK	香港证券交易所	中国香港	126,200	2,755,099.46	1.04
31	Postal Savings Bank of China Co Ltd	邮储银行	1658 HK	香港证券交易所	中国香港	600,000	2,438,884.80	0.92
32	PICC Property & Casualty Co Ltd	中国财险	2328 HK	香港证券交易所	中国香港	416,583	2,431,545.65	0.91
33	Hengan International Group Co Ltd	恒安国际	1044 HK	香港证券交易所	中国香港	43,000	2,384,169.74	0.90
34	Bank of Communications Co Ltd	交通银行	3328 HK	香港证券交易所	中国香港	529,400	2,311,489.15	0.87
35	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神华	1088 HK	香港证券交易所	中国香港	205,500	2,275,068.47	0.86
36	Shimao Group Holdings Ltd	世茂集团	813 HK	香港证券交易所	中国香港	73,000	2,187,140.74	0.82
37	Guangdong Investment Ltd	粤海投资	270 HK	香港证券交易所	中国香港	178,000	2,162,477.86	0.81
38	BYD Co Ltd	比亚迪	1211 HK	香港证券交易所	中国香港	38,500	2,104,771.29	0.79

				交易所				
39	China Vanke Co Ltd	万科	2202 HK	香港证券交易所	中国香港	90,600	2,027,562.77	0.76
40	China Minsheng Banking Corp Ltd	民生银行	1988 HK	香港证券交易所	中国香港	402,700	1,956,920.97	0.74
41	China Resources Gas Group Ltd	华润燃气	1193 HK	香港证券交易所	中国香港	54,000	1,862,047.44	0.70
42	Want Want China Holdings Ltd	中国旺旺	151 HK	香港证券交易所	中国香港	338,000	1,806,144.91	0.68
43	China CITIC Bank Corp Ltd	中信银行	998 HK	香港证券交易所	中国香港	585,000	1,806,144.91	0.68
44	CITIC Securities Co Ltd	中信证券	6030 HK	香港证券交易所	中国香港	131,000	1,754,224.98	0.66
45	China Telecom Corp Ltd	中国电信	728 HK	香港证券交易所	中国香港	798,000	1,581,767.51	0.59
46	Sinopharm Group Co Ltd	国药控股	1099 HK	香港证券交易所	中国香港	81,200	1,471,559.15	0.55
47	China Unicom Hong Kong Ltd	中国联通	762 HK	香港证券交易所	中国香港	370,000	1,416,106.03	0.53
48	Fosun International Ltd	复星国际	656 HK	香港证券交易所	中国香港	155,000	1,396,010.36	0.52
49	China Taiping Insurance Holdings	中国太平	966 HK	香港证券交易所	中国香港	97,800	1,109,533.64	0.42

	Co Ltd			交易 所				
--	--------	--	--	---------	--	--	--	--

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 期末积极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

无。

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	Tencent Holdings Ltd	700 HK	12,426,543.07	5.24
2	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	11,651,237.66	4.92
3	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1398 HK	10,047,573.62	4.24
4	China Mobile Ltd	941 HK	8,507,166.37	3.59
5	Bank of China Ltd	3988 HK	6,132,377.19	2.59
6	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	2382 HK	4,773,164.60	2.01
7	China Mengniu Dairy Co Ltd	2319 HK	4,534,618.34	1.91
8	CNOOC Ltd	883 HK	3,564,737.68	1.50
9	China Conch Venture Holdings Ltd	586 HK	3,479,303.49	1.47
10	China Merchants Bank Co Ltd	3968 HK	3,361,827.29	1.42
11	China Resources Land Ltd	1109 HK	2,792,527.36	1.18
12	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	2,694,582.63	1.14
13	Shimao Group Holdings Ltd	813 HK	2,337,379.70	0.99
14	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	2,232,156.75	0.94
15	Sino Biopharmaceutical Ltd	1177 HK	2,214,009.61	0.93
16	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	2,144,891.02	0.91
17	Sunac China Holdings Ltd	1918 HK	2,081,254.93	0.88
18	China Tower Corp Ltd	788 HK	1,941,560.30	0.82
19	Shenzhen International Group Holdings Ltd	2313 HK	1,757,970.43	0.74
20	Country Garden Holdings Co Ltd	2007 HK	1,704,703.15	0.72

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	Tencent Holdings Ltd	700 HK	15,997,075.76	6.75
2	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	6,763,339.15	2.85
3	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1398 HK	6,360,120.22	2.68
4	China Mobile Ltd	941 HK	5,853,236.98	2.47
5	Bank of China Ltd	3988 HK	3,932,515.84	1.66
6	CNOOC Ltd	883 HK	2,961,981.64	1.25
7	China Merchants Bank Co Ltd	3968 HK	2,216,418.45	0.94
8	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	2,001,524.14	0.84
9	China Communications Construction Co Ltd	1800 HK	1,581,107.14	0.67
10	New China Life Insurance Co Ltd	1336 HK	1,579,836.32	0.67
11	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	1,504,013.29	0.63
12	Haitong Securities Co Ltd	6837 HK	1,448,217.31	0.61
13	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	1,387,833.99	0.59
14	China Resources Land Ltd	1109 HK	1,308,295.36	0.55
15	China Tower Corp Ltd	788 HK	1,286,747.06	0.54
16	Shenzhen International Group Holdings Ltd	2313 HK	1,238,103.64	0.52
17	Sunac China Holdings Ltd	1918 HK	1,215,208.79	0.51
18	Sino Biopharmaceutical Ltd	1177 HK	1,194,993.21	0.50
19	Country Garden Holdings Co Ltd	2007 HK	1,174,154.22	0.50
20	Geely Automobile Holdings Ltd	175 HK	1,064,595.41	0.45

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	123,588,229.66
卖出收入（成交）总额	82,868,249.24

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

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A+	2,001,000.00	0.75

注：本基金持有的债券主要采用国际权威评级机构（标普、惠誉、穆迪等）提供的债券信用评级信息，上述机构未提供评级信息的债券采用内部评级。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	019627	20 国债 01	20,000	2,001,000.00	0.75
---	--------	----------	--------	--------------	------

注:报告期末,本基金仅持有上述 1 支债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细
无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细
无。

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
无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

(1) 2020 年 4 月 20 日,根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚决字〔2020〕7 号),对中国工商银行股份有限公司理财产品数量漏报、贷款核销业务漏报、委托贷款业务应报未报等违法违规事实,因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定,罚款合计 270 万元。

2020 年 4 月 20 日,根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚决字〔2020〕4 号),对监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在的违法违规行为,因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定,中国银行保险监督管理委员会对中国银行股份有限公司处以罚款 270 万元的行政处罚。

本基金投资于“INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD. (1398)”、“BANK OF CHINA LTD. (3988)”的决策程序说明:本基金投资目标为紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化,INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD.、BANK OF CHINA LTD. 为标的指数成份股,本基金投资于“INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD.”、“BANK OF CHINA LTD.”股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中,其他八名证券发行主体无被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.11.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规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	3,336,387.02
4	应收利息	22,742.74
5	应收申购款	944,388.68
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,303,518.44

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

无。

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

无。

§ 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 (%)
19,106	17,731.93	96,363,270.67	28.44	242,423,013.56	71.56

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	高湘崧	1,784,500.00	3.39
2	高友鹤	1,633,422.00	3.10
3	林素貂	1,216,100.00	2.31
4	马国中	1,090,000.00	2.07
5	徐工	1,060,000.00	2.01
6	常志兵	1,019,800.00	1.94
7	范萍	1,000,000.00	1.90
8	陈锦春	1,000,000.00	1.90
9	林小军	929,300.00	1.76

10	吴玲	884,100.00	1.68
----	----	------------	------

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	2,389,178.25	0.71

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	>=100
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	269,889,733.44
本报告期基金总申购份额	220,613,405.96
减:本报告期基金总赎回份额	151,716,855.17
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	338,786,284.23

§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

2020年4月8日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，宋振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

2020年5月6日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告》，郭杰先生任公司机构首席投资官。

2020年6月19日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

(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、托管人的托管业务部门及其相关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

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	

花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	88,146,189.32	42.69%	176,292.35	64.68%	
兴业证券股份有限公司 Industrial Securities Co.,Ltd.	-	78,019,040.77	37.79%	54,613.35	20.04%	
招商证券(香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	38,848,106.19	18.82%	38,848.21	14.25%	
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	1,289,671.01	0.62%	2,579.34	0.95%	
华泰证券股份有限公司 HUATAI SECURITIES CO.,LTD.	-	153,471.61	0.07%	243.54	0.09%	
中国国际金融香港证券有限 公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	-	-	-	-	
尚乘资产管理有限公司 AMTD Asset Management Limited	-	-	-	-	-	
摩根大通证券(亚太)有限 公司 J.P.Morgan Securities	-	-	-	-	-	

(Asia Pacific) Limited						
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	
瑞士信贷 (香港) 有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	
建银国际证券有限公司 CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	
农银证券有限公司 CAF Securities Company Limited	-	-	-	-	-	
野村国际 (香港) 有限公司 Nomura International (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	
中国平安证券 (香港) 有限公司 Ping An of China Securities (Hong Kong) Co. Ltd.	-	-	-	-	-	

注:1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范, 在近一年内无重大违规行为;
- (2) 公司财务状况良好;
- (3) 有良好的内控制度, 在业内有良好的声誉;
- (4) 有较强的研究能力, 能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告, 并能根据基金投资的特殊要求, 提供专门的研究报告;
- (5) 建立了广泛的信息网络, 能及时提供准确地信息资讯服务。基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议, 并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券股份有限公司 HUATAI SECURITIES CO., LTD.	2, 002, 710. 00	100. 00%	-	-	-	-

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根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 01 月 22 日
2	嘉实基金管理有限公司关于面向养老金客户实施特定申购费率的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 04 月 02 日
3	关于嘉实 H 股指数 (QDII-LOF) 2020 年 4 月 10 日至 4 月 13 日暂停申购、赎回及定投业务公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 04 月 08 日
4	关于嘉实 H 股指数 (QDII-LOF) 2020 年 4 月 30 日暂停申购、赎回及定投业务公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 04 月 28 日
5	关于嘉实 H 股指数 (QDII-LOF) 2020 年 7 月 1 日暂停申购、赎回及定投业务公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 06 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2020/01/01 至 2020/02/26	56,085,249.58	65,367,964.55	56,085,249.58	65,367,964.55	19.29
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回,基金管理人可能无法及时变现基金资产,可能对基金份额净值产生一定的影响;极端情况下可能引发基金的流动性风险,发生暂停赎回或延缓支付赎回款项;若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元,还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

- (1) 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 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

12.3 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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2020年08月29日