

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

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 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 2017 年 3 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§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.....	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.....	13
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	42
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	43
8.4 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.....	43
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	47
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	51
8.7 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.....	51

8.8 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	51
8.9 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	51
8.10 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	52
8.11 投资组合报告附注	52
§9 基金份额持有人信息.....	53
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
9.2 期末上市基金前十名持有人	53
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
9.4 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	54
§10 开放式基金份额变动.....	54
§11 重大事件揭示.....	54
11.1 基金份额持有人大会决议	54
11.2 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	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
11.4 基金投资策略的改变	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
11.8 其他重大事件	57
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 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	2,821,392,599.38 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) 自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号华润	北京市西城区闹市口大街 1 号

	大厦 8 层	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	153,457,097.50	-76,418,912.37	-3,860,133.35
本期利润	288,947,762.86	-185,095,132.26	9,205,324.32
加权平均基金份额本期利润	0.1565	-0.3188	0.1027
本期加权平均净值利润率	22.77%	-39.34%	13.83%
本期基金份额净值增长率	3.56%	-19.79%	14.88%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末

期末可供分配利润	-1,252,251,824.76	-279,527,201.96	-27,965,312.31
期末可供分配基金份额利润	-0.4438	-0.4699	-0.3435
期末基金资产净值	2,024,748,300.01	412,143,215.57	70,335,280.51
期末基金份额净值	0.7176	0.6929	0.8639
3.1.3 累计期末指标	2016年末	2015年末	2014年末
基金份额累计净值增长率	-28.24%	-30.71%	-13.61%

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。

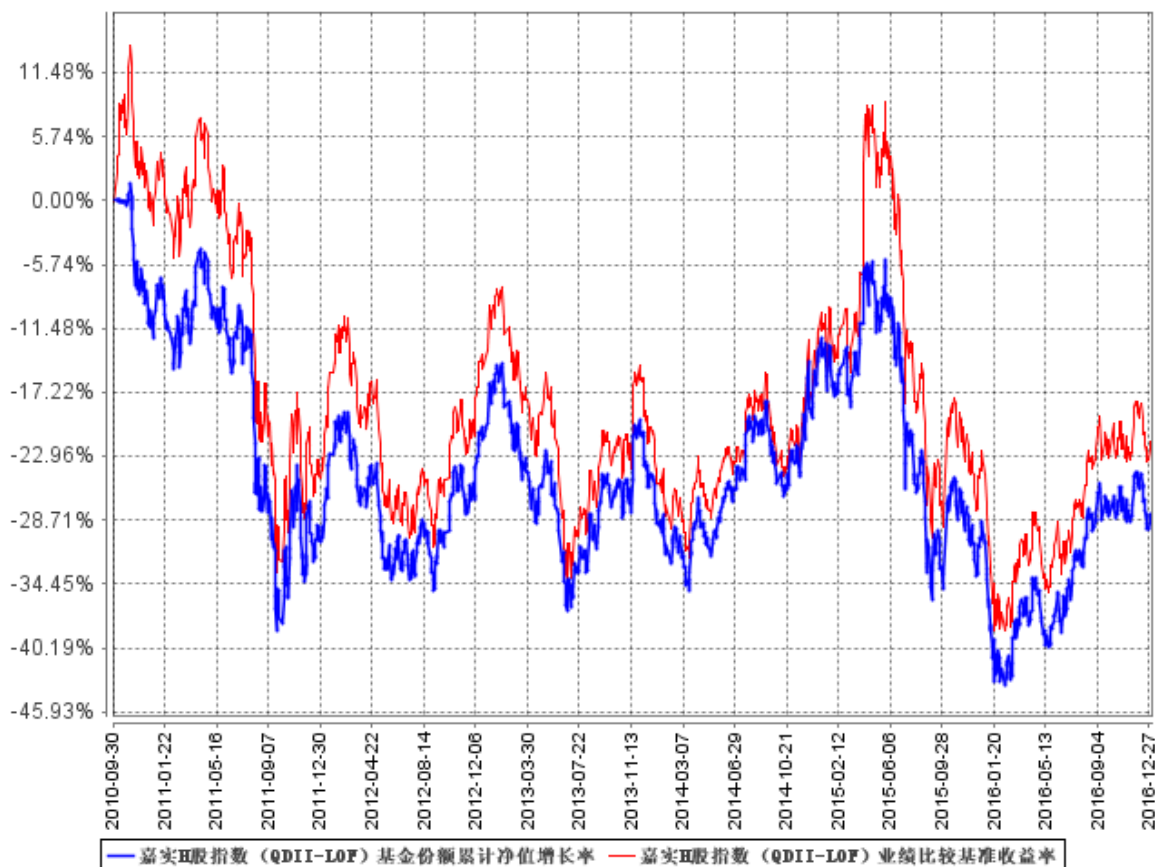
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	0.22%	1.00%	1.87%	1.18%	-1.65%	-0.18%
过去六个月	10.28%	1.02%	12.85%	1.14%	-2.57%	-0.12%
过去一年	3.56%	1.32%	3.83%	1.42%	-0.27%	-0.10%
过去三年	-4.57%	1.37%	-1.18%	1.48%	-3.39%	-0.11%
过去五年	3.55%	1.33%	4.32%	1.43%	-0.77%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-28.24%	1.41%	-21.64%	1.52%	-6.60%	-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

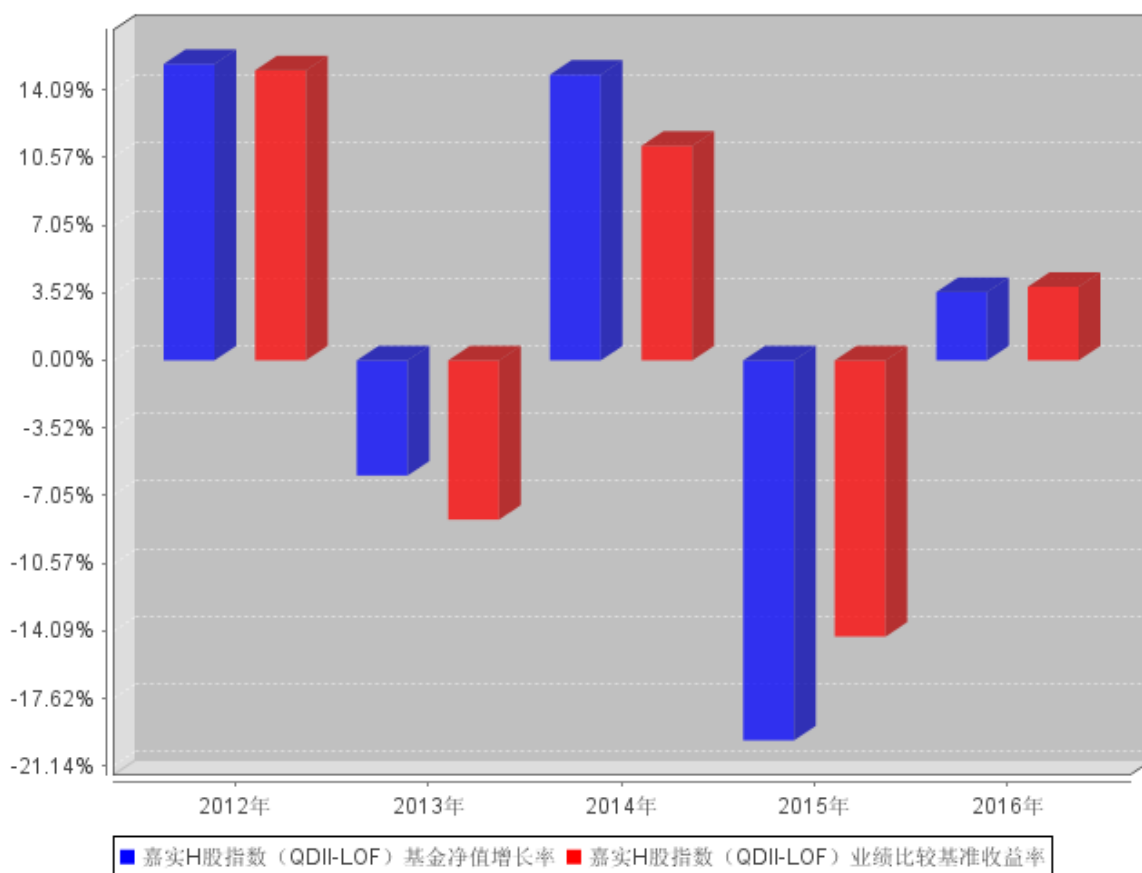
(2010年9月30日至2016年12月31日)

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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实H股指数(QDII-LOF)过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

§ 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12月31日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、111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、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、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、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、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、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。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		
陈正宪	本基金、嘉实沪深	2016 年 1	-	11 年	曾任职于中国台湾台育证

	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	月 5 日			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。
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。
杨宇	本基金、嘉实沪深 300ETF 及其联接 (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、离任日期均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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，每季度和每年度完成公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 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 6 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

报告期内, 本基金日均跟踪误差为 0.17%, 年度化拟合偏离度为 2.66%, 符合基金合同中约定的日均跟踪误差不超过 0.3% 的限制。

本基金跟踪误差主要来源于限制投资股票的替代选择、股票组合最高仓位限制、人民币港币的汇率变化以及申购赎回的冲击。

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。报告期内, 恒生中国企业指数震荡下跌 2.75%。

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 0.7176 元; 本报告期基金份额净值增长率为 3.56%, 业绩比较基准收益率为 3.83%。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内, 基金管理人有关法律稽核工作情况如下:

(1) 继续内控前置, 在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面, 事前进行合规性审核、监控。对于新产品、新业务, 从战略规划到具体产品方案, 在投资范围、投资工具、运作规则等方面, 重点关注防控风险。

(2) 合规管理: 主要从事前合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面, 积极开展各项合规管理工作。

(3) 内部审计: 按季度对销售、投资、后台和其它业务开展内审, 完成相应内审报告及其后续改进跟踪。继续发起公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证, 全面完成公司及基金的外审等。

(4) 法律事务: 完成大量的日常法律事务工作, 包括合同、协议审查 (包括各类产品及业务),

主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理，继续完善公司整体风险架构表，推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制，努力实现适当风险水平下的效益最大化。

此外，我们还积极配合监管机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成季度、年度监察稽核报告和各项统计、专题报告。

4.7 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。

4.8 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-1,252,251,824.76 元、3.1.2 “期末基金份额净值”为 0.7176 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。

4.9 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 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20637 号

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)全体基金份额持有人:

我们审计了后附的嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)(以下简称“嘉实 H 股指数(QDII-LOF)基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是嘉实 H 股指数(QDII-LOF)基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映;

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为，上述嘉实 H 股指数(QDII-LOF)基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、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，公允反映了嘉实 H 股指数(QDII-LOF)基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天

会计师事务所(特殊普通合伙)

中国·上海市

注册会计师

许 康 玮

张 勇

2017 年 3 月 22 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	106,860,055.96	23,863,555.41

结算备付金		-	-
存出保证金		1,887,407.69	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,918,334,872.24	389,495,394.03
其中：股票投资		1,918,334,872.24	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		816,679.89	2,743,728.17
应收利息	7.4.7.5	24,778.57	3,696.22
应收股利		-	-
应收申购款		694,780.59	5,122,801.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,028,618,574.94	421,229,175.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,082,918.52	8,245,552.84
应付管理人报酬		1,322,167.55	253,847.94
应付托管费		440,722.50	84,615.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	450,981.63	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	573,484.73	501,943.34
负债合计		3,870,274.93	9,085,960.09
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,821,392,599.38	594,806,600.49
未分配利润	7.4.7.10	-796,644,299.37	-182,663,384.92
所有者权益合计		2,024,748,300.01	412,143,215.57
负债和所有者权益总计		2,028,618,574.94	421,229,175.66

注：报告截止日2016年12月31日，基金份额净值0.7176元，基金份额总额2,821,392,599.38份。

7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
一、收入		310,131,454.65	-176,452,007.43
1. 利息收入		898,054.82	162,253.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	898,054.82	162,253.56
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		172,690,227.34	-61,971,350.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	112,265,609.06	-81,792,378.21
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	60,424,618.28	19,821,027.76
3. 公允价值变动收益	7.4.7.17	135,490,665.36	-108,676,219.89
4. 汇兑收益	7.4.7.21	-934,656.84	-6,917,549.63
5. 其他收入	7.4.7.18	1,987,163.97	950,858.98
减：二、费用		21,183,691.79	8,643,124.83
1. 管理人报酬		9,310,207.55	3,462,713.21
2. 托管费		3,103,402.52	1,154,237.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	7,694,647.20	3,401,973.84
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	1,075,434.52	624,200.02
三、利润总额		288,947,762.86	-185,095,132.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润		288,947,762.86	-185,095,132.26

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31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)	-	288,947,762.86	288,947,762.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,226,585,998.89	-902,928,677.31	1,323,657,321.58
其中：1. 基金申购款	4,477,247,742.03	-1,559,067,535.74	2,918,180,206.29
2. 基金赎回款	-2,250,661,743.14	656,138,858.43	-1,594,522,884.71
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)	2,821,392,599.38	-796,644,299.37	2,024,748,300.01
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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)	-	-185,095,132.26	-185,095,132.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	513,386,189.93	13,516,877.39	526,903,067.32
其中：1. 基金申购款	1,441,446,742.89	-139,578,920.43	1,301,867,822.46
2. 基金赎回款	-928,060,552.96	153,095,797.82	-774,964,755.14
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)	594,806,600.49	-182,663,384.92	412,143,215.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

赵学军

基金管理人负责人

王红

主管会计工作负责人

常旭

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算或者发行价计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，对于场外认购、申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按除息日基金份额净值转成相应基金份额。场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式。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。每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。

(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，在境内不予征收营业税(于 2016 年 5 月 1 日前)或增值税(自 2016 年 5 月 1 日起)且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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	106,860,055.96	23,863,555.41
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	106,860,055.96	23,863,555.41

注：定期存款的存款期限指票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,892,679,329.85	1,918,334,872.24	25,655,542.39
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	1,892,679,329.85	1,918,334,872.24	25,655,542.39
项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	499,330,517.00	389,495,394.03	-109,835,122.97
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	499,330,517.00	389,495,394.03	-109,835,122.97

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	24,066.13	3,686.93
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	690.16	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	22.28	9.29
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	24,778.57	3,696.22

7.4.7.6 其他资产

本期末（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	450,981.63	-
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	450,981.63	-
----	------------	---

注：上年度末（2015年12月31日），本基金无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,897.11	31,235.14
预提费用	390,000.00	430,000.00
应付指数使用费	179,587.62	40,708.20
其他	-	-
合计	573,484.73	501,943.34

7.4.7.9 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12月31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	4,477,247,742.03	4,477,247,742.03
本期赎回	-2,250,661,743.14	-2,250,661,743.14
本期末	2,821,392,599.38	2,821,392,599.38

7.4.7.10 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	153,457,097.50	135,490,665.36	288,947,762.86
本期基金份额交易产生的变动数	-1,126,181,720.30	223,253,042.99	-902,928,677.31
其中：基金申购款	-2,226,315,579.37	667,248,043.63	-1,559,067,535.74
基金赎回款	1,100,133,859.07	-443,995,000.64	656,138,858.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,252,251,824.76	455,607,525.39	-796,644,299.37

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	503,431.59	159,458.98
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	-	-
其他	394,623.23	2,794.58
合计	898,054.82	162,253.56

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,509,978,833.06	619,744,559.01
卖出股票成本总额	1,397,713,224.00	701,536,937.22
买卖股票差价收入	112,265,609.06	-81,792,378.21

7.4.7.13 基金投资收益

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日），本基金无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日），本基金无债券投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日），本基金无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	60,424,618.28	19,821,027.76
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	60,424,618.28	19,821,027.76
----	---------------	---------------

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	135,490,665.36	-108,676,219.89
——股票投资	135,490,665.36	-108,676,219.89
——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	135,490,665.36	-108,676,219.89

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	1,987,163.97	950,858.98
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	1,987,163.97	950,858.98

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	7,694,647.20	3,401,973.84
银行间市场交易费用	-	-
合计	7,694,647.20	3,401,973.84

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	90,000.00	70,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
债券托管账户维护费	-	-
银行划款手续费	6,145.87	9,521.94
指数使用费	496,544.38	184,678.08
上市年费	60,000.00	60,000.00
红利手续费	-	-
其他	122,744.27	-
合计	1,075,434.52	624,200.02

7.4.7.21 汇兑收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
汇兑收益	-934,656.84	-6,917,549.63
合计	-934,656.84	-6,917,549.63

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，要求2017年7月1日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

上述通知是对财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的《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[2016]140 号)的补充,该通知要求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,自 2016 年 5 月 1 日起执行。

7.4.9 关联方关系

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
中诚信托有限责任公司	基金管理人股东
立信投资有限责任公司	基金管理人股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人股东

7.4.10 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。

7.4.10.1 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 12 月 31 日)及上年度可比期间(2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,310,207.55	3,462,713.21
其中:支付销售机构的客户维护费	337,010.15	353,091.90

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

	月 31 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	3,103,402.52	1,154,237.76

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。

7.4.10.3 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12月31日）及上年度可比期间（2015年1月1日至2015年12月31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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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12月31日）及上年度可比期间（2015年1月1日至2015年12月31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。

7.4.10.4.2 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12月31日）及上年度末（2015年12月31日），其他关联方未持有本基金。

7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	98,812,725.73	503,431.59	23,789,354.78	159,458.98
美国道富银行	8,047,330.23	-	74,200.63	-

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。

7.4.10.6 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12月31日）及上年度可比期间（2015年1月1日至2015年12月31日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本期（2016年1月1日至2016年12月31日），本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末 (2016 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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 12 月 31 日), 本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末 (2016 年 12 月 31 日), 本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末 (2016 年 12 月 31 日), 本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末 (2016 年 12 月 31 日), 本基金无交易所市场债券正回购余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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)。

7.4.13.3 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 7.4.12 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 7.4.12.3 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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:

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2016 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	106,860,055.96	-	-	-	106,860,055.96
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	1,887,407.69	-	-	-	1,887,407.69

交易性金融资产				1,918,334,872.24	1,918,334,872.24
衍生金融资产					
买入返售金融资产					
应收证券清算款				816,679.89	816,679.89
应收利息				24,778.57	24,778.57
应收股利					
应收申购款	13,133.19			681,647.40	694,780.59
递延所得税资产					
其他资产					
资产总计	108,760,596.84			1,919,857,978.10	2,028,618,574.94
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				1,082,918.52	1,082,918.52
应付管理人报酬				1,322,167.55	1,322,167.55
应付托管费				440,722.50	440,722.50
应付销售服务费					
应付交易费用				450,981.63	450,981.63
应交税费					
应付利息					
应付利润					
递延所得税负债					
其他负债				573,484.73	573,484.73
负债总计				3,870,274.93	3,870,274.93
利率敏感度缺口	108,760,596.84			1,915,987,703.17	2,024,748,300.01
上年度末 2015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	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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016 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	-	8,047,501.90	-	8,047,501.90
交易性金融资产	-	1,918,334,872.24	-	1,918,334,872.24

应收证券清算款	-	385,555.14	-	385,555.14
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	1,926,767,929.28	-	1,926,767,929.28
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	-	1,926,767,929.28	-	1,926,767,929.28
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

7.4.13.4.2.2 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12月31日)	上年度末 (2015年12月31日)
	所有外币相对人民币升值 5%	96,338,396.46	19,615,667.72
	所有外币相对人民币贬值 5%	-96,338,396.46	-19,615,667.72

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31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	1,918,334,872.24	94.74	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	1,918,334,872.24	94.74	389,495,394.03	94.50

7.4.13.4.3.2 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12月31日)	上年度末(2015年12月31日)
	业绩比较基准上升5%	93,145,082.99	18,386,264.22

	业绩比较基准下降 5%	-93, 145, 082. 99	-18, 386, 264. 22
--	-------------	-------------------	-------------------

7.4.13.4.4 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。

7.4.14 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 1,918,334,872.24 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,918,334,872.24	94.56
	其中：普通股	1,918,334,872.24	94.56
	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	106,860,055.96	5.27
8	其他各项资产	3,423,646.74	0.17
9	合计	2,028,618,574.94	100.00

注：通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 1,139,539,792.25 元，占基金资产净值的比例为 56.28%。

8.2 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	1,918,334,872.24	94.74
合计	1,918,334,872.24	94.74

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 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	占基金资产净值比列(%)
非必需消费品	52,947,375.23	2.62
必需消费品	8,124,834.33	0.40
能源	238,765,811.56	11.79
金融	1,355,264,478.07	66.93
医疗保健	29,174,050.07	1.44
工业	112,395,203.87	5.55
原材料	19,949,988.18	0.99
房地产	17,818,263.51	0.88
电信服务	36,135,270.01	1.78
公用事业	47,759,597.41	2.36
合计	1,918,334,872.24	94.74

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。

8.3.2 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。

8.4 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

8.4.1 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	占基金资产净值比列(%)
1	Bank of China Ltd	中国银行	3988 HK	香港证券交易所	中国香港	54,499,000	167,699,657.69	8.28
2	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	工商银行	1398 HK	香港证券交易所	中国香港	40,020,000	166,462,049.43	8.22
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	4,461,500	154,845,226.96	7.65
4	China	招商银	3968	香港	中国	9,023,350	146,739,448.38	7.25

	Merchants Bank Co., Ltd.	行	HK	证券交易所	香港			
5	China Life Insurance Co. Ltd.	中国人寿	2628 HK	香港证券交易所	中国香港	6,368,000	115,064,041.54	5.68
6	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	21,835,600	107,426,894.06	5.31
7	Bank of Communications Co., Ltd.	交通银行	3328 HK	香港证券交易所	中国香港	19,846,400	99,593,226.31	4.92
8	PetroChina Co. Ltd.	中国石油股份	857 HK	香港证券交易所	中国香港	18,056,000	93,354,355.40	4.61
9	Agricultural Bank of China Ltd.	农业银行	1288 HK	香港证券交易所	中国香港	31,191,000	88,724,103.28	4.38
10	China CITIC Bank Corporation Ltd.	中信银行	998 HK	香港证券交易所	中国香港	18,652,000	82,254,094.56	4.06
11	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	民生银行	1988 HK	香港证券交易所	中国香港	9,292,500	68,908,421.31	3.40
12	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	中国太保	2601 HK	香港证券交易所	中国香港	2,018,800	48,847,885.11	2.41
13	PICC Property and Casualty Co. Ltd.	中国财险	2328 HK	香港证券交易所	中国香港	3,936,389	42,535,363.03	2.10
14	China Shenhua Energy Co. Ltd.	中国神华	1088 HK	香港证券交易所	中国香港	2,908,500	37,984,562.10	1.88
15	China Telecom Corporation	中国电信	728 HK	香港证券交易所	中国香港	11,284,000	36,135,270.01	1.78

	Ltd.			交易所				
16	Haitong Securities Co., Ltd.	海通证券	6837 HK	香港证券交易所	中国香港	2,772,000	32,978,436.88	1.63
17	China Communications Construction Co. Ltd.	中国交通建设	1800 HK	香港证券交易所	中国香港	3,789,000	30,232,541.64	1.49
18	Sinopharm Group Co. Ltd	国药控股	1099 HK	香港证券交易所	中国香港	1,020,800	29,174,050.07	1.44
19	Citic Securities Co. Ltd	中信证券	6030 HK	香港证券交易所	中国香港	1,755,000	24,741,073.19	1.22
20	CSR Corporation Ltd.	中国南车	1766 HK	香港证券交易所	中国香港	3,741,000	23,290,678.89	1.15
21	NEW CHINA LIFE INSURANCE Co. Ltd	新华保险	1336 HK	香港证券交易所	中国香港	663,800	21,138,416.27	1.04
22	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	7,982,900	20,065,602.70	0.99
23	BYD Co. Ltd.	比亚迪股份	1211 HK	香港证券交易所	中国香港	548,500	20,042,592.32	0.99
24	GF SECURITIES CO LTD-H	广发证券	1776 HK	香港证券交易所	中国香港	1,383,600	20,025,080.50	0.99
25	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	1,057,000	19,949,988.18	0.99
26	China Railway	中国中	390	香港	中国	3,421,000	19,523,557.37	0.96

	Group Ltd.	铁	HK	证券 交易 所	香港			
27	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	中国银 河	6881 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	3,001,000	18,764,127.32	0.93
28	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	华泰证 券	6886 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	1,397,600	18,502,474.21	0.91
29	CHINA VANKE CO LTD-H	万科	2202 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	1,125,400	17,818,263.51	0.88
30	PEOPLE'S 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	6,348,000	17,375,749.40	0.86
31	Great Wall Motor Co. Ltd.	长城汽 车	2333 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	2,653,000	17,181,497.61	0.85
32	Huaneng Power Internationa l, Inc.	华能国 际电力 股份	902 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	3,622,000	16,653,164.23	0.82
33	Zhuzhou CRRC Times Electric Co., Ltd.	中车时 代电气	3898 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	468,500	16,490,716.75	0.81
34	CGN POWER CO LTD-H	中广核 电力	1816 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	8,599,000	16,383,728.88	0.81
35	Dongfeng Motor Group Co. Ltd.	东风集 团股份	489 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	2,322,000	15,723,285.30	0.78
36	China Railway Construction Corporation Ltd.	中国铁 建	1186 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	1,688,500	15,073,593.75	0.74
37	China	龙源电	916	香港	中国	2,716,000	14,722,704.30	0.73

	Longyuan Power Group Corporation Ltd.	力	HK	证券交易所	香港			
38	Tsingtao Brewery Co. Ltd.	青岛啤酒股份	168 HK	香港证券交易所	中国香港	310,000	8,124,834.33	0.40
39	Air China Ltd.	中国国航	753 HK	香港证券交易所	中国香港	1,758,000	7,784,115.47	0.38

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。

8.4.2 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

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 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	239,075,684.94	58.01
2	Bank of China Ltd	3988 HK	232,769,978.09	56.48
3	Ping An Insurance (Group) Co. of China Ltd.	2318 HK	222,025,290.89	53.87
4	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	202,860,698.62	49.22
5	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	158,060,483.40	38.35
6	China Life Insurance Co. Ltd.	2628 HK	151,053,525.13	36.65
7	Bank of Communications Co., Ltd.	3328 HK	141,926,258.23	34.44
8	PetroChina Co. Ltd.	857 HK	129,188,507.75	31.35
9	Agricultural Bank of	1288 HK	124,551,636.69	30.22

	China Ltd.			
10	China CITIC Bank Corporation Ltd.	998 HK	118,242,799.25	28.69
11	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	1988 HK	94,502,036.81	22.93
12	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	74,608,009.72	18.10
13	PICC Property and Casualty Co. Ltd.	2328 HK	68,237,769.64	16.56
14	China Telecom Corporation Ltd.	728 HK	57,633,710.12	13.98
15	China Shenhua Energy Co. Ltd.	1088 HK	53,815,003.31	13.06
16	Sinopharm Group Co. Ltd	1099 HK	49,354,822.01	11.98
17	Haitong Securities Co., Ltd.	6837 HK	45,937,159.57	11.15
18	China Communications Construction Co. Ltd.	1800 HK	44,216,861.78	10.73
19	Citic Securities Co. Ltd	6030 HK	43,105,506.39	10.46
20	CSR Corporation Ltd.	1766 HK	35,096,479.78	8.52
21	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	6886 HK	34,633,945.14	8.40
22	Dongfeng Motor Group Co. Ltd.	489 HK	31,842,321.13	7.73
23	BYD Co. Ltd.	1211 HK	28,560,146.87	6.93
24	China Cinda Asset Management Company Ltd.	1359 HK	27,915,525.41	6.77
25	Anhui Conch Cement Co. Ltd.	914 HK	27,531,999.60	6.68
26	China Railway Group Ltd.	390 HK	27,417,386.83	6.65
27	GF SECURITIES CO LTD-H	1776 HK	26,906,881.06	6.53
28	NEW CHINA LIFE INSURANCE Co. Ltd	1336 HK	26,574,756.55	6.45
29	PEOPLE'S INSURANCE COMPANY (GROUP) OF CHINA LIMITED	1339 HK	26,131,902.29	6.34
30	CGN POWER CO LTD-H	1816 HK	25,604,862.78	6.21
31	Huaneng Power	902 HK	24,798,030.24	6.02

	International, Inc.			
32	Great Wall Motor Co. Ltd.	2333 HK	24,677,587.79	5.99
33	DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	3699 HK	23,797,876.75	5.77
34	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	23,437,825.11	5.69
35	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	6881 HK	22,511,471.82	5.46
36	China Longyuan Power Group Corporation Ltd.	916 HK	21,205,090.06	5.15
37	Zhuzhou CSR Times Electric Co., Ltd.	3898 HK	19,015,136.83	4.61
38	China Railway Construction Corporation Ltd.	1186 HK	16,948,818.05	4.11
39	China Oilfield Services Ltd.	2883 HK	13,178,253.77	3.20
40	Air China Ltd.	753 HK	12,214,898.56	2.96
41	Tsingtao Brewery Co. Ltd.	168 HK	11,499,528.87	2.79
42	China National Building Material Co. Ltd.	3323 HK	8,395,472.47	2.04

8.5.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	1398 HK	139,654,544.56	33.88
2	Ping An Insurance (Group) Co. of China Ltd.	2318 HK	127,397,020.43	30.91
3	Bank of China Ltd	3988 HK	120,525,238.39	29.24
4	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	114,166,310.83	27.70
5	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	81,863,479.29	19.86
6	China Life Insurance	2628 HK	80,377,881.75	19.50

	Co. Ltd.			
7	Bank of Communications Co., Ltd.	3328 HK	79,665,992.01	19.33
8	Agricultural Bank of China Ltd.	1288 HK	67,236,488.29	16.31
9	PetroChina Co. Ltd.	857 HK	64,937,054.28	15.76
10	China CITIC Bank Corporation Ltd.	998 HK	64,534,916.37	15.66
11	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	1988 HK	51,445,932.13	12.48
12	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	41,440,720.43	10.05
13	China Telecom Corporation Ltd.	728 HK	34,435,477.98	8.36
14	DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	3699 HK	30,304,105.24	7.35
15	PICC Property and Casualty Co. Ltd.	2328 HK	28,922,941.20	7.02
16	China Shenhua Energy Co. Ltd.	1088 HK	27,800,461.27	6.75
17	Sinopharm Group Co. Ltd	1099 HK	26,395,453.47	6.40
18	Citic Securities Co. Ltd	6030 HK	23,954,804.97	5.81
19	China Communications Construction Co. Ltd.	1800 HK	23,216,335.55	5.63
20	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	6886 HK	20,861,269.35	5.06
21	Haitong Securities Co., Ltd.	6837 HK	20,536,558.56	4.98
22	Dongfeng Motor Group Co. Ltd.	489 HK	20,058,035.06	4.87
23	China Oilfield Services Ltd.	2883 HK	17,516,576.75	4.25
24	CSR Corporation Ltd.	1766 HK	17,087,756.28	4.15
25	NEW CHINA LIFE INSURANCE Co. Ltd	1336 HK	15,846,446.36	3.84
26	Anhui Conch Cement Co. Ltd.	914 HK	15,344,246.71	3.72
27	Great Wall Motor Co. Ltd.	2333 HK	14,646,167.48	3.55
28	China Cinda Asset	1359 HK	14,243,382.30	3.46

	Management Company Ltd.			
29	China Railway Group Ltd.	390 HK	13,899,660.85	3.37
30	CGN POWER CO LTD-H	1816 HK	13,529,299.63	3.28
31	PEOPLE'S INSURANCE COMPANY (GROUP) OF CHINA LIMITED	1339 HK	13,514,101.34	3.28
32	BYD Co. Ltd.	1211 HK	12,771,560.81	3.10
33	China Longyuan Power Group Corporation Ltd.	916 HK	12,064,203.87	2.93
34	Huaneng Power International, Inc.	902 HK	11,824,875.01	2.87
35	China National Building Material Co. Ltd.	3323 HK	10,637,854.03	2.58
36	GF SECURITIES CO LTD-H	1776 HK	10,610,108.22	2.57
37	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	9,712,350.08	2.36

8.5.3 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	2,791,062,036.85
卖出收入（成交）总额	1,509,978,833.06

注：8.5.1项“买入金额”、8.5.2项“卖出金额”及8.5.3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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 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	1,887,407.69
2	应收证券清算款	816,679.89
3	应收股利	-
4	应收利息	24,778.57
5	应收申购款	694,780.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,423,646.74

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.5.1 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。

8.11.5.2 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
14,955	188,658.82	2,481,984,615.73	87.97%	339,407,983.65	12.03%

9.2 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	国联证券股份有限公司	22,410,000.00	9.92%
2	长江证券—招商银行—长 江证券超越理财基金管 II 集合资产管理计划	9,723,394.00	4.31%
3	中银国际—中行—中银国 际证券中国红基金宝集 合资产管理计划	7,485,500.00	3.31%
4	中泰金融国际有限公司— 客户资金	5,366,500.00	2.38%
5	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	4,790,000.00	2.12%
6	宋树	3,333,300.00	1.48%
7	梁璋忠	2,541,003.00	1.13%
8	王春晖	2,475,000.00	1.10%
9	徐工	2,218,500.00	0.98%
10	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	2,097,414.00	0.93%

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

9.3 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	454,244.37	0.02%

9.4 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

§ 10 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	4,477,247,742.03
减:本报告期基金总赎回份额	2,250,661,743.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,821,392,599.38

§ 11 重大事件揭示**11.1 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。

11.2 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。

2016 年 1 月 5 日本基金管理人发布《关于嘉实 H 股指数 (QDII-LOF) 基金经理的变更公告》, 杨宇先生不再担任本基金基金经理, 聘请陈正宪先生、何如女士担任本基金基金经理。

(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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 90,000.00 元，该审计机构已连续 7 年为本基金提供审计服务。

11.6 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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚。

11.7 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	-	3,673,212,334.09	85.57%	1,784,040.00	73.92%	新增
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	531,013,414.46	12.37%	568,048.27	23.54%	-
高盛（亚洲）有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	45,515,896.87	1.06%	18,206.35	0.75%	-
瑞银证券亚洲有限公司 UBS Securities Asia Limited	-	43,086,300.12	1.00%	43,086.36	1.79%	-
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。

11.8 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参与大同证券定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 6 月 14 日
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	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

	日暂停申购赎回业务的公告		
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
16	嘉实基金管理有限公司关于旗下开放式基金通过陆金所资管开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016年7月1日
17	关于增加蛋卷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7月27日
18	关于增加深圳新兰德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7月27日
19	关于增加广源达信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7月29日
20	嘉实基金管理有限公司关于嘉实H股指数(QDII-LOF)2016年8月2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8月3日
21	关于增加“万得投顾”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8月5日
22	关于增加深圳腾元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9月1日
23	嘉实基金管理有限公司关于对中国银行借记卡持卡人调整基金直销交易优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016年9月1日
24	嘉实基金管理有限公司关于嘉实H股指数(QDII-LOF)2016年10月10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9月29日
25	嘉实基金管理有限公司关于嘉实H股指数(QDII-LOF)2016年10月21日暂停申购赎回及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016年10月22日
26	关于增加北京汇成基金销售有限公司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11月29日
27	关于嘉实H股指数(QDII-LOF)2016年12月26日、12月27日暂停申购赎回及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016年12月22日
28	关于增加东海期货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12月28日

§ 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

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

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, 或发电子邮件, E-mail: service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2017年3月29日