

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF) 2017 年年度报告摘要

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：2018 年 03 月 28 日

§ 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 2018 年 3 月 23 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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	544,323,281.30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)65215588	(010)66275853
----	---------------	---------------

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

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

§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	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	211,944,461.22	153,457,097.50	-76,418,912.37
本期利润	226,694,466.74	288,947,762.86	-185,095,132.26
加权平均基金份额本期利润	0.1297	0.1565	-0.3188
本期加权平均净值利润率	16.56%	22.77%	-39.34%
本期基金份额净值	16.78%	3.56%	-19.79%

增长率			
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-160,989,441.90	-1,252,251,824.76	-279,527,201.96
期末可供分配基金份额利润	-0.2958	-0.4438	-0.4699
期末基金资产净值	456,134,736.46	2,024,748,300.01	412,143,215.57
期末基金份额净值	0.8380	0.7176	0.6929
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-16.20%	-28.24%	-30.71%

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	净值增长率 ①	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	3.94%	1.13%	5.59%	1.21%	-1.65%	-0.08%
过去六个月	8.18%	0.99%	8.80%	1.05%	-0.62%	-0.06%
过去一年	16.78%	0.92%	16.47%	0.96%	0.31%	-0.04%
过去三年	-3.00%	1.32%	3.53%	1.43%	-6.53%	-0.11%
过去五年	4.75%	1.28%	5.55%	1.38%	-0.80%	-0.10%

自基金合同 生效起至今	-16.20%	1.35%	-8.73%	1.46%	-7.47%	-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）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



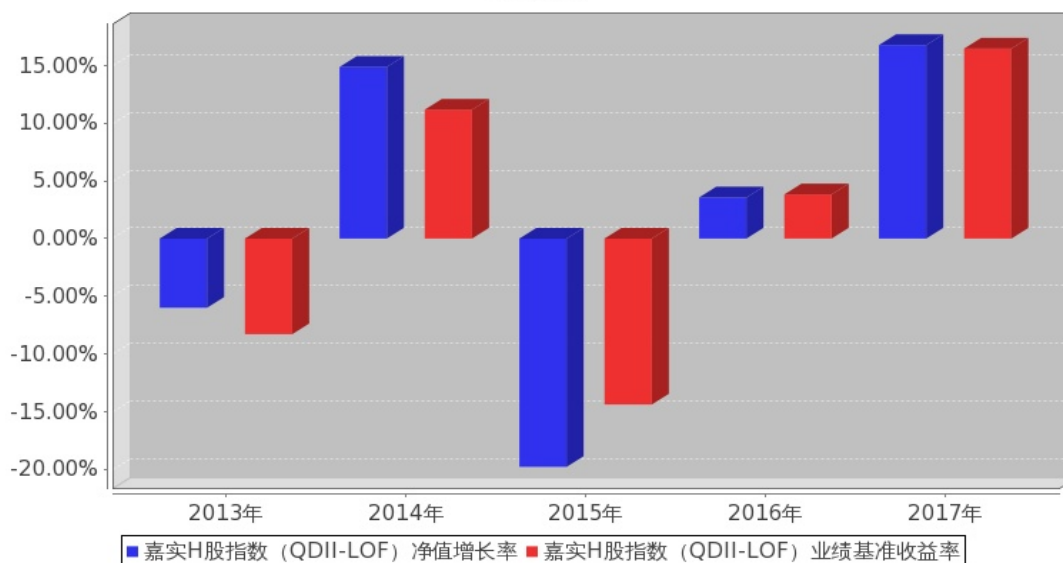
图：嘉实H股指数（QDII-LOF）基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2010年9月30日至2017年12月31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）1、组合投资比例限制）的有关约定。

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）基金每年净值增长率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2017年12月31日，基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、141只开放式证券投资基金，具体包括嘉实元和、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）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、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、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、嘉实新消费股票基金、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、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实稳泰债券、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、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、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、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实新添华定期混合、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、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、嘉实稳康纯债债券、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、嘉实稳愉债券、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实稳悦纯债债券、嘉实致博纯债债券、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。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300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、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基金经理	2016年1月5日	-	12年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,中国台湾籍。
何如	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、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、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实创业板ETF基金经理	2016年1月5日	-	11年	曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司(IA-ClaringtonInvestments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司(FranklinTempletonInvestmentsCorp.)。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。

注:(1)任职日期、离任日期是指公司作出决定后公告之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

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19次，均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0.13%，年度化拟合偏离度为2.06%，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。

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0.8380；本报告期基金份额净值增长率为16.78%，业绩比较基准收益率为16.47%。

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。报告期内，恒生中国企业指数上涨24.64%。

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 3.1.2 “期末可供分配利润”为-160,989,441.90 元,“期末可供分配基金份额利润”为-0.2958 元,“期末基金份额净值”为 0.8380 元,以及本基金基金合同(十九(三)基金收益分配原则)“3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值”的约定,因此本基金报告期内未实施利润分配,符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF) 2017 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师薛竞、张勇签字出具了“无保留意见的审计报告”(普华永道中天审字(2018)第 22487 号)。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 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：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	26,610,938.97	106,860,055.96
结算备付金		-	-
存出保证金		11,682.76	1,887,407.69
交易性金融资产	7.4.7.2	432,064,963.34	1,918,334,872.24
其中：股票投资		432,064,963.34	1,918,334,872.24
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		8,428,550.68	816,679.89
应收利息	7.4.7.5	9,141.23	24,778.57
应收股利		-	-
应收申购款		119,477.91	694,780.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		467,244,754.89	2,028,618,574.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016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		10,070,127.06	1,082,918.52
应付管理人报酬		394,241.17	1,322,167.55
应付托管费		131,413.70	440,722.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,738.15	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	510,498.35	573,484.73
负债合计		11,110,018.43	3,870,274.93
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	544,323,281.30	2,821,392,599.38
未分配利润	7.4.7.10	-88,188,544.84	-796,644,299.37
所有者权益合计		456,134,736.46	2,024,748,300.01
负债和所有者权益总计		467,244,754.89	2,028,618,574.94

注： 报告截止日2017年12月31日，基金份额净值0.8380元，基金份额总额544,323,281.30份。

7.2 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：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
一、收入		247,200,129.70	310,131,454.65
1. 利息收入		687,332.94	898,054.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	687,332.94	898,054.82
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		233,476,560.60	172,690,227.34
其中：股票投资收益	7.4.7.12	199,988,434.65	112,265,609.06
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	33,488,125.95	60,424,618.28
3. 公允价值变动收益	7.4.7.17	14,750,005.52	135,490,665.36
4. 汇兑收益	7.4.7.21	-4,391,596.07	-934,656.84
5. 其他收入	7.4.7.18	2,677,826.71	1,987,163.97
减：二、费用		20,505,662.96	21,183,691.79
1. 管理人报酬		10,406,065.07	9,310,207.55

2. 托管费		3,468,688.27	3,103,402.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	5,607,802.64	7,694,647.20
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	1,023,106.98	1,075,434.52
三、利润总额		226,694,466.74	288,947,762.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润		226,694,466.74	288,947,762.86

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：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	2,821,392,599.38	-796,644,299.37	2,024,748,300.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	226,694,466.74	226,694,466.74
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）	-2,277,069,318.08	481,761,287.79	-1,795,308,030.29
其中：1. 基金申购款	783,114,610.12	-170,362,898.34	612,751,711.78
2. 基金赎回款	-3,060,183,928.20	652,124,186.13	-2,408,059,742.07
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	544,323,281.30	-88,188,544.84	456,134,736.46

项目	上年度可比期间		
	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
权益(基金净值)			
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(净值减少以“-”号填列)	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(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
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

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：

经雷

王红

张公允

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 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
德意志证券亚洲有限公司	与基金管理人股东处于同一控股集团

7.4.4 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。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
德意志证券亚洲有限公司	73,723,134.71	2.60%

注：上年度可比期间(2016年1月1日至2016年12月31日)，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.4.1.2 债券交易

本期(2017年1月1日至2017年12月31日)及上年度可比期间(2016年1月1日至2016年12月31日)，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.4.1.3 债券回购交易

本期(2017年1月1日至2017年12月31日)及上年度可比期间(2016年1月1日至2016年12月31日)，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.4.1.4 基金交易

本期(2017年1月1日至2017年12月31日)及上年度可比期间(2016年1月1日至2016年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.4.1.5 权证交易

本期(2017年1月1日至2017年12月31日)及上年度可比期间(2016年1月1日至2016年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
德意志证券亚洲有限公司	22,116.96	1.09	-	-

注:(1)上述佣金按市场佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(2)上年度可比期间(2016年1月1日至2016年12月31日),本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.4.2 关联方报酬**7.4.4.2.1 基金管理费**

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,406,065.07	9,310,207.55
其中:支付销售机构的客户维护费	387,101.99	337,010.15

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司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。

7.4.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	3,468,688.27		3,103,402.52	

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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2017年1月1日至2017年12月31日）及上年度可比期间（2016年1月1日至2016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。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 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（2017年1月1日至2017年12月31日）及上年度可比期间（2016年1月1日至2016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。

7.4.4.4.2 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（2017年12月31日）及上年度末（2016年12月31日），其他关联方未持有本基金。

7.4.4.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016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
中国建设银行股份有限公司	17,985,368.46	550,855.03	98,812,725.73	503,431.59
美国道富银行	8,625,570.51	-	8,047,330.23	-

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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2017年1月1日至2017年12月31日）及上年度可比期间（2016年1月1日至

2016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。

7.4.5 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 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(2017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。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末(2017年12月31日)，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末(2017年12月31日)，本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末(2017年12月31日)，本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 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	432,064,963.34	92.47
	其中：普通股	432,064,963.34	92.47
	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	26,610,938.97	5.70
8	其他各项资产	8,568,852.58	1.83
9	合计	467,244,754.89	100.00

注：通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为12,162,356.75元，占基金资产净值的比例为2.67%。

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	432,064,963.34	94.72
合计	432,064,963.34	94.72

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	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	19,249,205.92	4.22
能源	46,685,759.91	10.24
金融	312,074,030.01	68.42
医疗保健	5,707,259.12	1.25
工业	23,071,132.71	5.06
原材料	6,420,415.73	1.41
房地产	5,802,887.22	1.27
电信服务	6,940,594.17	1.52
公用事业	6,113,678.55	1.34
合计	432,064,963.34	94.72

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前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

序	公司名称(英文)	公司名称	证券代码	所在证券	所属	数量(股)	公允价值	占基
---	----------	------	------	------	----	-------	------	----

号		(中文)		市场	国家 (地区)			金资 产净 值比 例 (%)
1	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	632,500	43,010,808.65	9.43
2	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	中国工商 银行股份 有限公司	1398 HK	香港证券 交易所	中国 香港	7,968,000	41,894,739.24	9.18
3	Bank of China Ltd	中国银行	3988 HK	香港证券 交易所	中国 香港	12,770,000	40,990,351.49	8.99
4	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行	3968 HK	香港证券 交易所	中国 香港	1,449,850	37,691,461.93	8.26
5	China Life Insurance Co Ltd	中国人寿	2628 HK	香港证券 交易所	中国 香港	1,260,000	25,857,204.03	5.67
6	China Petroleum & Chemical Corp	中国石化	386 HK	香港证券 交易所	中国 香港	4,317,600	20,680,286.34	4.53
7	Bank of Communications Co Ltd	交通银行	3328 HK	香港证券 交易所	中国 香港	4,249,400	20,602,272.53	4.52
8	China CITIC Bank Corp Ltd	中信银行	998 HK	香港证券 交易所	中国 香港	4,355,000	17,837,901.45	3.91
9	Agricultural Bank of China Ltd	农业银行	1288 HK	香港证券 交易所	中国 香港	5,411,000	16,464,116.80	3.61
10	PetroChina Co Ltd	中国石油	857 HK	香港证券 交易所	中国 香港	3,570,000	16,263,882.92	3.57

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；(3)投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站(<http://www.jsfund.cn>)的年度报告正文。

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前五名权益投资明细

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 累计买入金额前20名的股票明细

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	Bank of China Ltd	3988 HK	51,802,164.89	2.56
2	China Merchants Bank Co Ltd	3968 HK	48,914,440.74	2.42
3	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1398 HK	42,820,462.78	2.11
4	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	37,564,044.94	1.86
5	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	32,981,622.81	1.63
6	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	27,369,629.90	1.35
7	Bank of Communications Co Ltd	3328 HK	27,133,365.12	1.34
8	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	27,095,598.40	1.34
9	Postal Savings Bank of China Co Ltd	1658 HK	26,634,187.31	1.32
10	China CITIC Bank Corp Ltd	998 HK	26,187,407.60	1.29
11	PetroChina Co Ltd	857 HK	21,907,769.58	1.08
12	China Minsheng Banking Corp Ltd	1988 HK	20,116,282.97	0.99
13	China Pacific Insurance Group Co Ltd	2601 HK	17,441,984.96	0.86
14	PICC Property & Casualty Co Ltd	2328 HK	11,699,610.56	0.58
15	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	2238 HK	10,064,087.39	0.50
16	China Shenhua Energy Co Ltd	1088 HK	9,953,705.21	0.49
17	China Telecom Corp Ltd	728 HK	8,575,484.77	0.42
18	Haitong Securities Co Ltd	6837 HK	7,966,041.08	0.39
19	China Communications Construction Co Ltd	1800 HK	7,950,195.23	0.39
20	New China Life Insurance Co Ltd	1336 HK	7,787,444.01	0.38

8.5.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

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	Ping An Insurance Group	2318 HK	220,277,863.35	10.88

	Co of China Ltd			
2	China Merchants Bank Co Ltd	3968 HK	202,264,027.44	9.99
3	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1398 HK	192,800,579.86	9.52
4	Bank of China Ltd	3988 HK	190,627,201.32	9.41
5	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	140,514,670.74	6.94
6	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	121,093,078.55	5.98
7	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	108,671,619.72	5.37
8	Bank of Communications Co Ltd	3328 HK	105,581,031.64	5.21
9	PetroChina Co Ltd	857 HK	85,602,522.52	4.23
10	China CITIC Bank Corp Ltd	998 HK	85,524,324.71	4.22
11	China Minsheng Banking Corp Ltd	1988 HK	73,103,897.79	3.61
12	China Pacific Insurance Group Co Ltd	2601 HK	61,570,223.32	3.04
13	China Shenhua Energy Co Ltd	1088 HK	49,915,536.70	2.47
14	PICC Property & Casualty Co Ltd	2328 HK	48,218,797.93	2.38
15	China Telecom Corp Ltd	728 HK	38,140,400.02	1.88
16	China Communications Construction Co Ltd	1800 HK	34,996,725.12	1.73
17	Sinopharm Group Co Ltd	1099 HK	32,080,309.90	1.58
18	Haitong Securities Co Ltd	6837 HK	31,956,028.61	1.58
19	New China Life Insurance Co Ltd	1336 HK	27,178,127.62	1.34
20	Anhui Conch Cement Co Ltd	914 HK	26,144,923.24	1.29

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	565,354,157.25
卖出收入（成交）总额	2,266,362,506.32

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前十名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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明**

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

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	11,682.76
2	应收证券清算款	8,428,550.68
3	应收股利	-
4	应收利息	9,141.23
5	应收申购款	119,477.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,568,852.58

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 (%)
16,749	32,498.85	251,438,147.01	46.19	292,885,134.29	53.81

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	宁波汇创资产管理有限公司—汇创—霁 泽—艾比之路私募投资基金	4,656,600.00	3.63
2	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	3,330,700.00	2.60
3	宋树	2,999,900.00	2.34
4	梁璋忠	2,586,603.00	2.02
5	王春晖	2,245,000.00	1.75
6	张素兰	2,000,000.00	1.56
7	郑晖	1,996,357.00	1.56
8	高湘崧	1,839,600.00	1.43
9	周渊	1,389,600.00	1.08
10	长江证券—招商银行—长江证券超越理 财基金管家II集合资产管理计划	1,381,394.00	1.08

注：上述基金持有人份额均为场内份额。

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	652,593.99	0.12

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	2,821,392,599.38
本报告期基金总申购份额	783,114,610.12
减：本报告期基金总赎回份额	3,060,183,928.20
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	544,323,281.30

§ 11 重大事件揭示**11.1 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。

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**

2017年12月26日本基金管理人发布公告，牛成立先生为公司联席董事长，赵学军先生为公司董事长并代行公司总经理职权，邓红国先生因任期届满不再担任公司董事长职务。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2017年9月1日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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 100,000.00 元，该审计机构已连续 8 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

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 HUATAI SECURITIES CO., LTD.	-	2,152,506,162.37	76.02%	943,457.20	46.41%	
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	237,473,580.07	8.39%	474,935.31	23.36%	
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	-	181,290,883.22	6.40%	280,002.98	13.77%	
高盛（亚洲）有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C.	-	173,651,928.57	6.13%	302,247.14	14.87%	
德意志证券亚洲有限公司 Deutsche Securities Asia Limited	-	73,723,134.71	2.60%	22,116.96	1.09%	
中信建投证券股份有限公司	-	9,106,406.47	0.32%	6,374.47	0.31%	新增
瑞银证券亚洲有限公司 UBS Securities Asia Limited	-	3,920,641.34	0.14%	3,920.64	0.19%	

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	-	-	-	-	-	-	
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.	-	-	-	-	-	-	
金贝塔证券有限公司	-	-	-	-	-	-	新增

iGoldenbeta Securities C ompany Limited						
--	--	--	--	--	--	--

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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2017/01/24 至 2017/01/25, 2017/02/13 至 2017/02/21, 2017/03/24 至 2017/12/31	560,225,684.20	64,933,766.23	441,000,000.00	184,159,450.43	33.83
	2	2017/01/01 至 2017/03/26, 2017/06/13 至 2017/06/14	1,086,257,522.23	-	1,086,257,522.23	-	-
	3	2017/01/01 至 2017/02/12, 2017/03/27 至 2017/06/12, 2017/06/15 至	599,541,085.23	-	599,541,085.23	-	-

		2017/06/18					
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

2018年3月21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》，自2018年3月21日起经雷先生担任公司总经理。自经雷先生任公司总经理职务之日起，公司董事长赵学军先生不再代任公司总经理职务。

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

2018 年 03 月 28 日