

# 嘉实恒生中国企业指数证券投资基金( QDII-LOF )

## 2017年第三季度报告

2017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: 中国银行股份有限公司  
报告送出日期: 2017年10月25日

**§ 1 重要提示**

基金管理人的董事会及监事会对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责任。

基金经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。

本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。

本基金的过往业绩未经审计。

本报告期中的财务资料未经审计。

报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 2017 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 嘉实 H 指数联接 QDII-LOF

场内简称 现金型

基金管理人 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

报告期末基金份额总额 944,007,258.88 份

基金份额净值 0.910 元

基金净值增长率 -0.4%

净值增长率标准差 0.3%

业绩比较基准 人民币港币(恒生中国企业指数)

风险收益特征 高风险、高收益

基金管理人 嘉实基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

英文名称 State Street Bank and Trust Company

中文名称 嘉实 H 指数联接 QDII-LOF

3.1 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标 单位:人民币元 报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)

1.本期已实现收益 20,598,338.10

2.本期利润 31,462,252.81

3.期初平均基金份额利润 0.0329

4.期末基金份额净值 761,023,887.80

5.期末基金资产净值 0.9062

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）扣除相应用后的余额，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本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于上述数字。

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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 4.08% 0.85% 30.4% 0.89% 104% -0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

图表标题: 嘉实恒生中国企业指数证券投资基金( QDII-LOF ) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较图

图表显示: 嘉实恒生中国企业指数证券投资基金( QDII-LOF ) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较图