

嘉实海外中国股票混合型证券投资基金 2016 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 日

§1 重要提示

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。

根据基金管理人 2015 年 8 月 3 日发布的《嘉实基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》，嘉实海外中国股票股票型证券投资基金自 2015 年 8 月 3 日起更名为嘉实海外中国股票混合型证券投资基金。

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。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实海外中国股票混合型证券投资基金
基金简称	嘉实海外中国股票混合(QDII)
基金主代码	070012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月12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
报告期末基金份额总额	8,116,930,463.04份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分散投资风险，获取中长期稳定收益
投资策略	基于对宏观经济形势、财政/货币政策以及相关发展状况等因素的综合分析和预测，决定基金在股票和现金之间的配置比例，进行自上而下的资产配置和自下而上的精选投资品种。
业绩比较基准	MSCI 中国指数
风险收益特征	较高风险、较高收益

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	王永民
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010) 65182266	(010) 66594942

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行(香港)有限公司
注册地址		香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港花园道1号中银大厦

邮政编码	-
------	---

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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-143,236,367.16	346,867,571.84	918,055,566.93
本期利润	266,419,017.88	-171,178,023.61	-9,370,285.29
加权平均基金份额本期利润	0.0314	-0.0166	-0.0007
本期加权平均净值利润率	5.10%	-2.42%	-0.10%
本期基金份额净值增长率	5.22%	-4.10%	0.00%
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	-2,777,921,183.71	-3,216,226,597.61	-4,132,341,054.57
期末可供分配基金份额利润	-0.3422	-0.3677	-0.3447
期末基金资产净值	5,396,837,236.46	5,531,373,533.03	7,900,690,743.57
期末基金份额净值	0.665	0.632	0.659
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	-33.50%	-36.80%	-34.10%

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

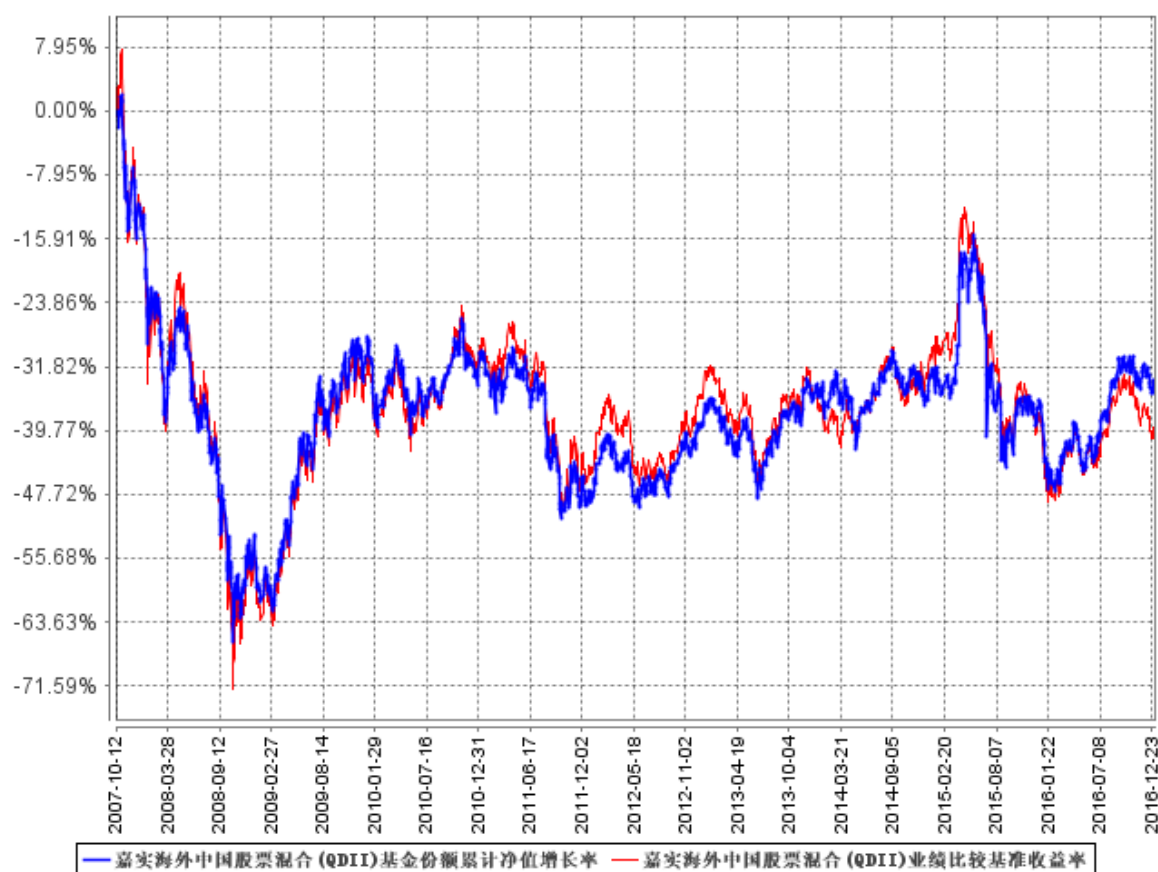
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.63%	0.91%	-7.14%	0.94%	5.51%	-0.03%
过去六	12.14%	0.92%	5.30%	0.96%	6.84%	-0.04%

个月						
过去一年	5.22%	1.21%	-1.38%	1.22%	6.60%	-0.01%
过去三年	0.91%	1.39%	-7.20%	1.32%	8.11%	0.07%
过去五年	29.38%	1.27%	10.66%	1.26%	18.72%	0.01%
自基金合同生效起至今	-33.50%	1.62%	-39.37%	1.88%	5.87%	-0.26%

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

嘉实海外中国股票混合(QDII)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：嘉实海外中国股票混合(QDII)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

(2007年10月12日至2016年12月31日)

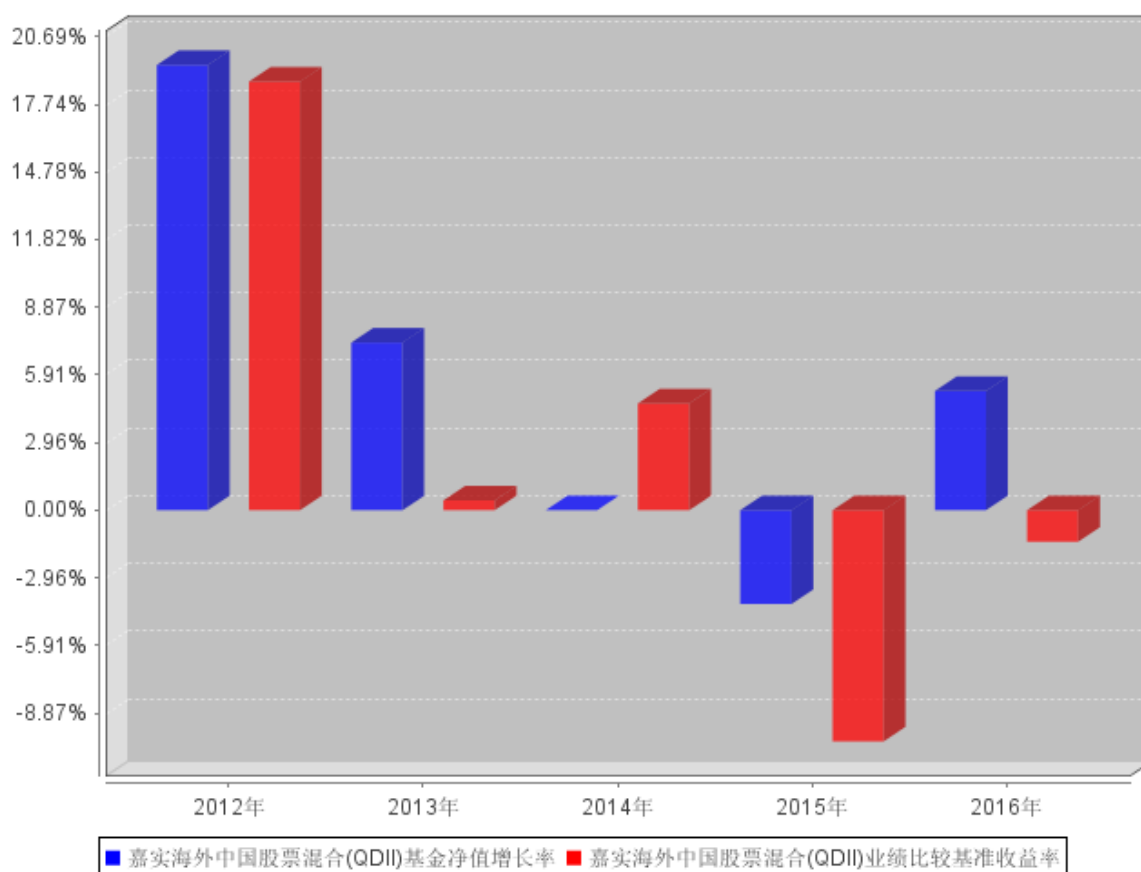
注1：按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金各

项资产配置比例符合基金合同第十四条（（九）投资限制）的规定：（1）持有同一家银行的存款不得超过本基金净值的 20%，在托管账户的存款可以不受上述限制；（2）持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%；（3）本公司管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量，指数基金可以不受上述限制；（4）持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%；（5）相对于基金资产净值，股票投资比例为 60—100%。

注 2：2016 年 5 月 25 日，本基金管理人发布《关于新增嘉实海外中国股票混合(QDII)基金经理的公告》，增聘胡彬先生担任本基金基金经理职务，与基金经理蒋一茜女士共同管理本基金。

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

嘉实海外中国股票混合(QDII)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		
蒋一茜	本基金基金经理	2015年10月24日	—	7年	曾任上海申银证券机构销售部及国际部交易员、LG securities (HK) Co., Ltd 研究员、上海沪光国际资产管理（香港）有限公司基金经理助理、德意志资产管理（香港）有限公司基金经理。2009年9月加入嘉实国际资产管理有限公司，2012年9月加入嘉实基金，至今兼任 DWS China Equity Fund、DWS Invest Chinese Equities 基金经理，2012年3月9日至今兼任 Harvest China Equity Fund 基金经理职务。硕士研究生，具有基金从业资格，香港籍。
胡彬	本基金基金经理	2016年5月25日	—	10年	曾任 Citigroup Australia 战略研究员、UBS AG 副董事、Sumitomo Mitsui Asset Management (HK) 基金经理。2013年6月1日至2015年11月6日期间任 New China Fund 基金基金经理。2015年11月30日加入嘉实国际资产管理有限公司。

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；（3）2017年3月4日，本基金管理人发布《关于嘉实海外中国股票混合(QDII)基金经理的变更公告》，胡彬先生不再担任本基金基金经理，由蒋一茜女士单独管理本基金。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在报告期内，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、

《嘉实海外中国股票混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 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

MSCI 中国指数在新年一开始市场由于 A 股启动熔断机制以及估值过高引发投资者争相获利沽售，在 A 股的拖累下港股也遭到抛售，期间人民币贬值也触发海外投资者担忧，资金持续流出中国股市。此后随着两会的结束，A 股市场并未如不少投资者担心的出现恐慌“最后一跌”，市场从三月开始反弹，持续到 4 月中旬到达季度高点，随后在货币政策收紧以及房地产、基建等终端需求恢复可持续性的担忧下，市场持续缩量下调至 5 月中下旬的低点；在港股通等资金持续流入的推动下，香港市场随后有一定反弹，但是国际投资者持续看空中国经济，6 月 24 日英国公投更出现黑天鹅事件，公投决议英国退出欧盟，导致全球股市大幅波动。此后，MSCI 中国指数在第三季度大幅反弹，跑赢 A 股及美日欧等主要发达国家指数。香港市场的平均估值在年中处于 10 年历史平均值以下，属于严重低估的水平。一方面，随着人民币国际化的深入发展，国内机构海外资产配置需求上升，在深港通获批及沪港通全年额度取消等政策利好下，国内机构资金通过港股通持续流入香港市场，布局港股价值洼地。另一方面，海外主流基金长期大幅低配中国股票，随着新兴市场的反弹，有迹象显示海外基金开始逐步增加海外中国股票的配置。市场在最后几个月呈区间震荡整固态势，川普当选美国总统后市场憧憬财政刺激，美元大幅升值，资金回流到美国以及其它发达市场。MSCI 中国指数全年略微上涨 1.2%，由于 OPEC 减产支撑原油价格，能源股全年大幅上升，跑赢最多；原材料板块在憧憬美国财政刺激基建投资下也有强劲表现，成长板块中则科技股表现最好。受到房地产调控政策的负面影响，地产股受到大量沽盘抛售，跑输最多；公用事业板块在减电价的担忧下也大幅跑输。

16 年整体宏观经济基本面保持稳定，货币政策一定程度上回归稳健，尽管面临产能过剩以及经济转型等诸多挑战，中国经济层次丰富，回旋余地大，基本面基本向好的趋势没有改变。领先指标 PMI 从 8 月起重回荣枯线以上，零售增长相对稳定，持续扮演经济增长稳定器的作用。房地产市场在三季度出现过热现象，地王频出，导致各地陆续出台调控政策，但是我们认为房地产市场过热触发系统性风险的可能性较低。中长期看，改革和创新依旧是今后经济政策的重点。与世界主要经济体相比，中国的财政与货币政策在应对下行周期以及突发事件的政策选择空间更大。央行等政策制定当局与市场的沟通明显加强，宏观审慎性监管进一步加强。中国是世界主要经济体中坚定推行结构性改革和转型的国家，具体改革措施将陆续落地，我们维持对中国经济中长期的正面展望。风险方面，我们关注人民币持续贬值导致国内资产贬值以及资本外流的风险，以

及去杠杆和过剩行业产能退出可能引发的区域性信用事件风险。

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 0.665 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.22%，业绩比较基准收益率为-1.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，我们预期宏观经济维持稳定态势，通胀尤其是 PPI 继续回升。增长主要风险在于：地产调控发力和汽车购置税优惠减半施压下终端需求逐步走缓、信用环境边际收紧和增值税优惠效果的退却下，私人部门投资短期难有很大起色。流动性方面，房价与通胀压力面前、市场需要继续消化货币政策边际收紧的压力，而在金融加速去杠杆的指导思想下，预计 1 季度可能仍将是各类金融监管和抑制资产价格泡沫政策手段的陆续出台期。市场当前核心是消化稳健中性的货币政策带来的流动性收紧效应，这需要几方面的契机——通胀警报的解除、增长压力面前货币政策重新倒向放松、或者是市场本身出现更为客观的回撤。对于人民币进一步贬值会否对股票市场造成系统性风险，我们判断依然不排除这种可能。但是边际上这种概率在变小，主要原因：

1) 短期大幅贬值的概率在变小：央行有意在控制贬值的幅速度； 2) 市场对贬值的心理准备在加强、以及客观的风险敞口在下降；3) 美元通常在两次加息之后会出现阶段性贬值。从全球市场来看，川普当选后导致的风险资产上涨趋势在短期内可能逆转，近期发达和新兴国家的经济惊喜指数都达到多年来的高位，意味着即使经济数据没有逆转但要达到投资者更高的预期也将更困难。此外，在川普当选后投资者对股市的乐观情绪大幅飙升，导致各市场股票的技术指标都在高位，意味着近期投资者对股市的情绪可能过份乐观。但从中长期而言，我们依然看好股票相对债券。而在经济周期好转，盈利触底反弹和估值依然十分具有吸引力的大背景下，我们更看好新兴相对发达市场股票。而在新兴市场中我们更看好海外中国股票的表现，主要由于估值便宜，企业盈利在今年有恢复性增长，海外基金对 MSCI 中国股票仍有很大的低配，未来在资产配置上有可能逐步增加对中国的配置。此外，我们预计国内资金通过港股通投资港股这个价值洼地的流动性也将继续保持强劲。投资主题上我们主要看好受益于供给侧改革等宏观政策的板块（如水泥、基建、环保、国企改革标的）、今年盈利前景有望改善板块（如传统零售、券商和医药）、受益于息差回升的金融板块（如保险），以及稳健成长板块（如汽车、互联网等）。

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-2,777,921,183.71 元、3.1.2 “期末基金份额净值”为 0.665 元，以及本基金基金合同（十九（二）收益分配原则）“4、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；5、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值”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 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实海外中国股票混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金

份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

嘉实海外中国股票混合型证券投资基金 2016 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、注册会计师许康玮、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(2017)第 20643 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：嘉实海外中国股票混合型证券投资基金

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	258,198,523.89	196,008,573.34
结算备付金		11,415,362.09	—
存出保证金		—	1,218,443.76
交易性金融资产	7.4.7.2	5,127,114,881.69	5,447,097,394.47
其中：股票投资		5,127,114,881.69	5,447,097,394.47
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		14,025,717.84	54,372,534.25
应收利息	7.4.7.5	7,542.87	30,265.77

应收股利		5,494,867.59	375,180.55
应收申购款		-	416,219.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,416,256,895.97	5,699,518,611.76
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		-	145,458,602.06
应付赎回款		9,201,512.52	11,844,330.03
应付管理人报酬		8,271,774.02	8,441,855.70
应付托管费		1,378,628.99	1,406,975.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	97,290.78	495,749.57
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	470,453.20	497,565.43
负债合计		19,419,659.51	168,145,078.73
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	8,116,930,463.04	8,747,600,130.64
未分配利润	7.4.7.10	-2,720,093,226.58	-3,216,226,597.61
所有者权益合计		5,396,837,236.46	5,531,373,533.03
负债和所有者权益总计		5,416,256,895.97	5,699,518,611.76

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.665 元，基金份额总额

8,116,930,463.04 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实海外中国股票混合型证券投资基金

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		394,220,964.96	36,509,712.81
1. 利息收入		681,227.88	718,288.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	681,227.88	718,288.14

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		-31,373,157.35	503,634,972.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-143,965,008.61	345,904,332.67
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	5,683,136.00	2,658,043.23
股利收益	7.4.7.16	106,908,715.26	155,072,596.21
3. 公允价值变动收益	7.4.7.17	409,655,385.04	-518,045,595.45
4. 汇兑收益	7.4.7.21	15,120,861.47	47,408,164.63
5. 其他收入	7.4.7.18	136,647.92	2,793,883.38
减：二、费用		127,801,947.08	207,687,736.42
1. 管理人报酬		93,952,705.13	126,984,778.84
2. 托管费		15,658,784.20	21,164,129.77
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	17,360,215.49	57,748,119.14
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	830,242.26	1,790,708.67
三、利润总额		266,419,017.88	-171,178,023.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润		266,419,017.88	-171,178,023.61

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实海外中国股票混合型证券投资基金

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）	8,747,600,130.64	-3,216,226,597.61	5,531,373,533.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	266,419,017.88	266,419,017.88
三、本期基金份额交易	-630,669,667.60	229,714,353.15	-400,955,314.45

产生的基金净值变动数			
其中：1. 基金申购款	133,843,671.14	-53,158,172.68	80,685,498.46
2. 基金赎回款	-764,513,338.74	282,872,525.83	-481,640,812.91
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）	8,116,930,463.04	-2,720,093,226.58	5,396,837,236.46
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）	11,987,601,922.00	-4,086,911,178.43	7,900,690,743.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-171,178,023.61	-171,178,023.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-3,240,001,791.36	1,041,862,604.43	-2,198,139,186.93
其中：1. 基金申购款	4,169,899,893.56	-832,988,418.28	3,336,911,475.28
2. 基金赎回款	-7,409,901,684.92	1,874,851,022.71	-5,535,050,662.21
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）	8,747,600,130.64	-3,216,226,597.61	5,531,373,533.03

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：

<u>赵学军</u>	<u>王红</u>	<u>常旭</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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

本基金本报告期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、基金注册登记机构、基金销售机构

中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国银行(香港)有限公司	基金托管人的子公司、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
中银国际证券有限公司	与境外资产托管人处于同一控股集团

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 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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
德意志证券亚洲有限公司	104,406,660.23	1.35%	2,028,304,887.63	8.24%
中银国际证券有限公司	91,075,493.79	1.18%	156,053,574.77	0.63%

7.4.4.1.2 债券交易

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债券交易。

7.4.4.1.3 债券回购交易

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(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基金交易。

7.4.4.1.5 权证交易

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 2016年1月1日至2016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	104,406.66	1.03%	—	—
中银国际证券有限公司	130,869.53	1.29%	—	—
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	2,067,537.42	6.12%	—	—
中银国际证券有限公司	187,264.28	0.55%	—	—

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

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	93,952,705.13	126,984,778.84
其中：支付销售机构的客户维护费	14,939,924.34	22,893,045.82

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.8%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.8% / 当年天数。

7.4.4.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	15,658,784.20	21,164,129.77

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.3%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×0.3% / 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（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。

7.4.4.4 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

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	20,391,217.00	20,391,217.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	20,391,217.00	20,391,217.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.25%	0.23%

注：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。

7.4.4.4.2 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（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。

7.4.4.5 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 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
中国银行	23,386,675.86	615,567.64	97,524,878.48	706,390.69
中国银行(香港)	234,811,848.03	-	98,483,694.86	-

有限公司				
------	--	--	--	--

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中国银行(香港)有限公司保管，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（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。

7.4.5 期末（2016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（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。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
940 HK	CHINA ANIMAL HEALTHCARE L	2015年3月30日	重大事项停牌	1.04（港币）	-	-	6,387,000	30,172,361.86	5,941,764.78	-

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（2016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（2016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	5,127,114,881.69	94.66
	其中：普通股	4,313,338,867.16	79.64

	存托凭证	813,776,014.53	15.02
	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	269,613,885.98	4.98
8	其他各项资产	19,528,128.30	0.36
9	合计	5,416,256,895.97	100.00

注：通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 774,658,245.74 元，占基金资产净值的比例为 14.35%。

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(%)
美国	831,337,605.80	15.40
中国香港	4,295,777,275.89	79.60
合计	5,127,114,881.69	95.00

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币

元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
非必需消费品	544,595,164.05	10.09
必需消费品	221,974,463.42	4.11
能源	356,065,662.94	6.60
金融	1,190,180,432.12	22.05
医疗保健	128,553,176.30	2.38
工业	426,124,650.44	7.90
信息技术	1,326,012,139.30	24.57
原材料	231,130,184.74	4.28

房地产	216,341,716.05	4.01
电信服务	452,535,203.08	8.39
公用事业	33,602,089.25	0.62
合计	5,127,114,881.69	95.00

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。

8.4 期末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	3,129,100	530,972,432.42	9.84
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA UN	纽约证券交易所	美国	719,635	438,357,003.04	8.12
3	IND & COMM BK OF CHINA-H	工商银行	1398 HK	香港证券交易所	中国香港	83,316,040	346,550,693.87	6.42
4	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	建设银行	939 HK	香港证券交易所	中国香港	63,192,960	337,464,605.86	6.25
5	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香港证券交易所	中国香港	3,924,500	288,563,469.49	5.35
6	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	中国联通	762 HK	香港证券交易所	中国香港	20,300,000	163,971,733.59	3.04
7	PETROCHINA CO LTD-H	中国石油	857 HK	香港证券交易所	中国香港	24,022,000	124,200,173.09	2.30
8	METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	中国中冶	1618 HK	香港证券交易所	中国香港	44,173,000	119,329,834.49	2.21

				所				
9	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	3,300,000	114,533,060.40	2.12
10	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	751 HK	香港证券交易所	中国香港	25,000,000	98,843,355.00	1.83

注：（1）本表所使用的证券代码为彭博代码。（2）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。

8.5 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	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA UN	289,407,050.36	5.23
2	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	751 HK	105,146,877.51	1.90
3	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	998 HK	97,311,879.68	1.76
4	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	817 HK	93,934,373.94	1.70
5	CHINA MOBILE LTD	941 HK	85,939,999.30	1.55
6	IND & COMM BK OF CHINA-H	1398 HK	85,039,588.14	1.54
7	CTRP.COM INTERNATIONAL-ADR	CTRP UW	80,338,059.87	1.45
8	METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	1618 HK	78,125,796.89	1.41
9	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	77,576,455.81	1.40
10	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	3377 HK	76,461,017.56	1.38
11	JD.COM INC-ADR	JD UW	72,531,267.74	1.31
12	TIBET WATER RESOURCES LTD	1115 HK	69,074,378.48	1.25

13	CHINA FOODS LTD	506 HK	64,964,074.70	1.17
14	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1800 HK	64,241,337.50	1.16
15	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	60,396,034.57	1.09
16	LONGFOR PROPERTIES	960 HK	59,244,931.21	1.07
17	TEXWINCA HOLDINGS LTD	321 HK	57,842,320.91	1.05
18	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	762 HK	56,785,352.03	1.03
19	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	56,518,367.57	1.02
20	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	6881 HK	54,491,163.61	0.99

8.5.2 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	IND & COMM BK OF CHINA-H	1398 HK	172,938,220.10	3.13
2	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	1316 HK	141,320,197.50	2.55
3	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	136,527,809.83	2.47
4	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	121,242,022.06	2.19
5	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2007 HK	110,910,408.79	2.01
6	SHENZHEN INTL HOLDINGS	152 HK	101,973,673.74	1.84
7	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	998 HK	94,035,267.75	1.70
8	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	92,160,617.43	1.67
9	HUANENG RENEWABLES CORP-H	958 HK	89,328,744.93	1.61
10	JD.COM INC-ADR	JD UW	87,984,225.21	1.59
11	LONGFOR PROPERTIES	960 HK	83,249,668.32	1.51
12	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	3377 HK	79,378,716.26	1.44
13	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	78,452,974.30	1.42
14	CHINA RESOURCES LAND	1109 HK	77,013,109.60	1.39

	LTD			
15	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	2314 HK	73,921,634.77	1.34
16	CHINA MOBILE LTD	941 HK	72,628,919.07	1.31
17	SINA CORP	SINA UW	72,440,663.01	1.31
18	CNOOC LTD	883 HK	72,279,796.22	1.31
19	CHINA MERCHANTS BANK-H	3968 HK	68,621,864.57	1.24
20	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	67,607,848.82	1.22

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	3,575,787,148.54
卖出收入（成交）总额	4,161,460,037.75

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

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	—
2	应收证券清算款	14,025,717.84
3	应收股利	5,494,867.59
4	应收利息	7,542.87
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	19,528,128.30

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

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
565,018	14,365.79	89,183,985.08	1.10%	8,027,746,477.96	98.90%

9.2 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	1,806,446.53	0.02%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年10月12日）基金份额总额	29,750,330,282.51
本报告期期初基金份额总额	8,747,600,130.64
本报告期基金总申购份额	133,843,671.14
减：本报告期基金总赎回份额	764,513,338.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,116,930,463.04

§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5月25日本基金管理人发布《关于新增嘉实海外中国股票混合(QDII)基金经理的公告》，增聘胡彬先生担任本基金基金经理职务，与基金经理蒋一茜女士共同管理本基金。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2016年12月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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 164,000.00 元，该审计机构已连续 10 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	-	831,516,047.74	10.75%	440,210.12	4.33%	-
中信建投（国际）证券有限公司 China Securities (International) Brokerage Company Limited	-	653,410,312.10	8.44%	890,278.12	8.76%	-
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	615,570,103.61	7.96%	820,718.41	8.07%	-
美林（亚太）有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	603,465,223.03	7.80%	641,674.64	6.31%	-
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	551,337,049.66	7.13%	538,485.48	5.30%	-
野村国际（香港）有限公司 Nomura International (Hong Kong) Limited	-	526,378,530.09	6.80%	637,047.75	6.27%	-
联昌证券有限公司 CIMB Securities Limited	-	464,123,724.38	6.00%	696,185.59	6.85%	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong	-	461,509,743.87	5.96%	521,310.61	5.13%	-

Kong Securities Limited						
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	432,994,682.60	5.60%	847,688.29	8.34%	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	371,776,172.68	4.80%	457,317.57	4.50%	-
招商证券(香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	330,842,168.69	4.28%	561,332.76	5.52%	-
工银国际证券有限公司 ICBC International Securities Limited	-	312,424,045.71	4.04%	468,636.09	4.61%	-
中国光大证券(香港)有限 公司 China Everbright Securities (HK) Limited	-	300,350,596.16	3.88%	450,525.89	4.43%	-
法国巴黎证券(亚洲)有限 公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited	-	288,439,714.77	3.73%	291,364.43	2.87%	-
摩根大通证券(亚太)有限 公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	197,993,205.40	2.56%	538,803.08	5.30%	-
大和资本市场香港有限公司 Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	-	172,094,236.77	2.22%	258,141.34	2.54%	-
瑞银证券亚洲有限公司 UBS Securities Asia Limited	-	111,142,999.73	1.44%	101,404.38	1.00%	-
德意志证券亚洲有限公司 Deutsche Securities Asia Limited	-	104,406,660.23	1.35%	104,406.66	1.03%	-
建银国际证券有限公司 CCB International Securities Limited	-	94,129,654.08	1.22%	485,052.27	4.77%	-
麦格理资本证券股份有限公 司 Macquarie Securities Group	-	93,698,684.16	1.21%	98,344.26	0.97%	-
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	-	91,075,493.79	1.18%	130,869.53	1.29%	-
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking	-	61,442,893.15	0.79%	92,164.34	0.91%	-

Corporation Limited						
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	50,600,235.65	0.65%	71,099.22	0.70%	-
申银万国证券(香港)有限公司 Shenyin Wanguo Securities (H.K.) Ltd.	-	14,113,061.95	0.18%	22,580.88	0.22%	-
凯基证券(香港)有限公司 KGI Securities (Hong Kong) Limited	-	2,469,573.54	0.03%	2,469.57	0.02%	-

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。

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
2017年3月29日