

# 嘉实沪港深精选股票型证券投资基金 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。

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 5 月 27 日（基金合同生效日）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	嘉实沪港深精选股票型证券投资基金
基金简称	嘉实沪港深精选股票
基金主代码	001878
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 27 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	1,188,751,926.24 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选个股和严格的风险控制，追求基金长期资产增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×45% +恒生指数收益率×45% +中债综合财富指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

### 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 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	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
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 5 月 27 日(基金合同生效日)- 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	218,470.70
本期利润	-13,339,335.58
加权平均基金份额本期利润	-0.0275
本期加权平均净值利润率	-2.39%
本期基金份额净值增长率	15.30%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末
期末可供分配利润	42,503,461.63
期末可供分配基金份额利润	0.0358
期末基金资产净值	1,370,421,881.05
期末基金份额净值	1.153
3.1.3 累计期末指标	2016 年末
基金份额累计净值增长率	15.30%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；（4）本基金合同生效日为 2016 年 5 月 27 日，本报告期自 2016 年 5 月 27 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

#### 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	1.68%	0.81%	-1.87%	0.64%	3.55%	0.17%
过去六个月	14.73%	0.87%	5.00%	0.65%	9.73%	0.22%
自基金合同 生效起至今	15.30%	0.80%	7.42%	0.72%	7.88%	0.08%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×45% +恒生指数收益率×45% +中债综合财富指数收益率×10%

沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的

300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成分股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。中债综合财富指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子，每日计算债券市场整体表现，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Benchmark}(0) = 1000$$

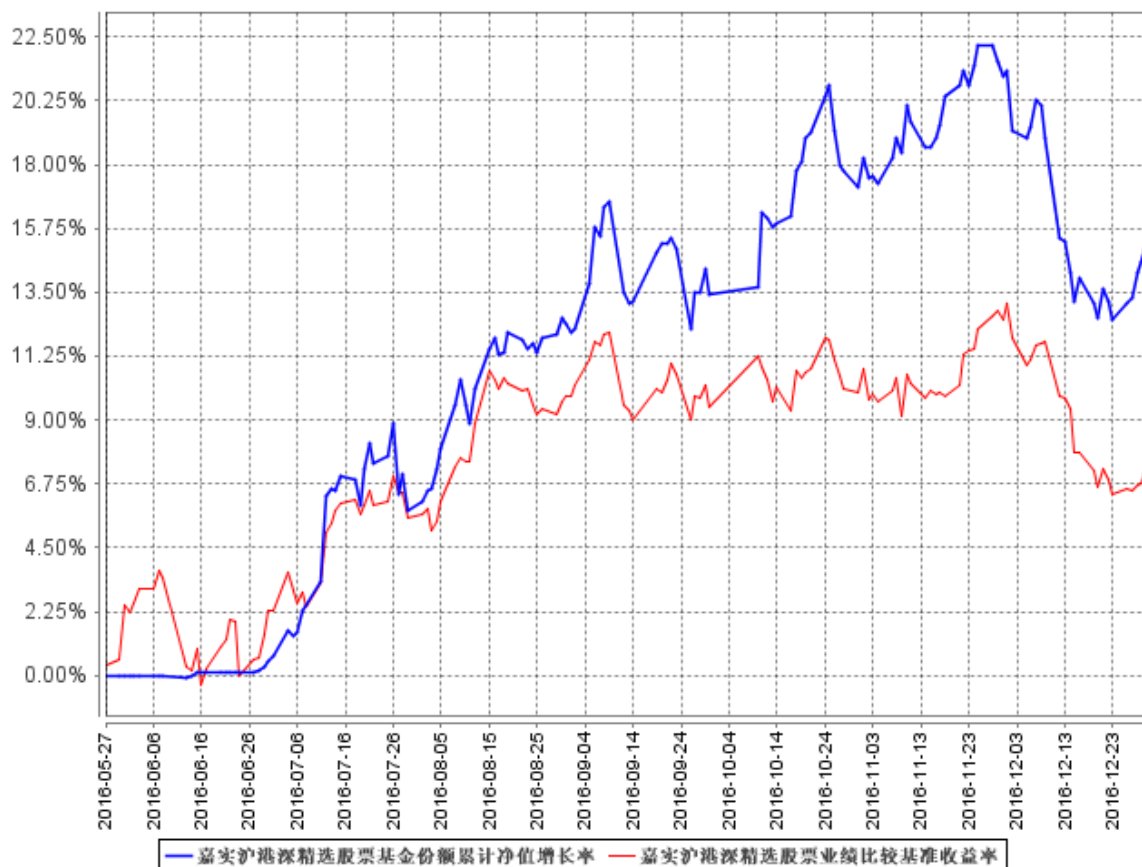
$$\text{Return}(t) = 45\% * (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 45\% * (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1) + 10\% * (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1)$$

$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) * \text{Benchmark}(t-1)$$

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

### 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

嘉实沪港深精选股票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



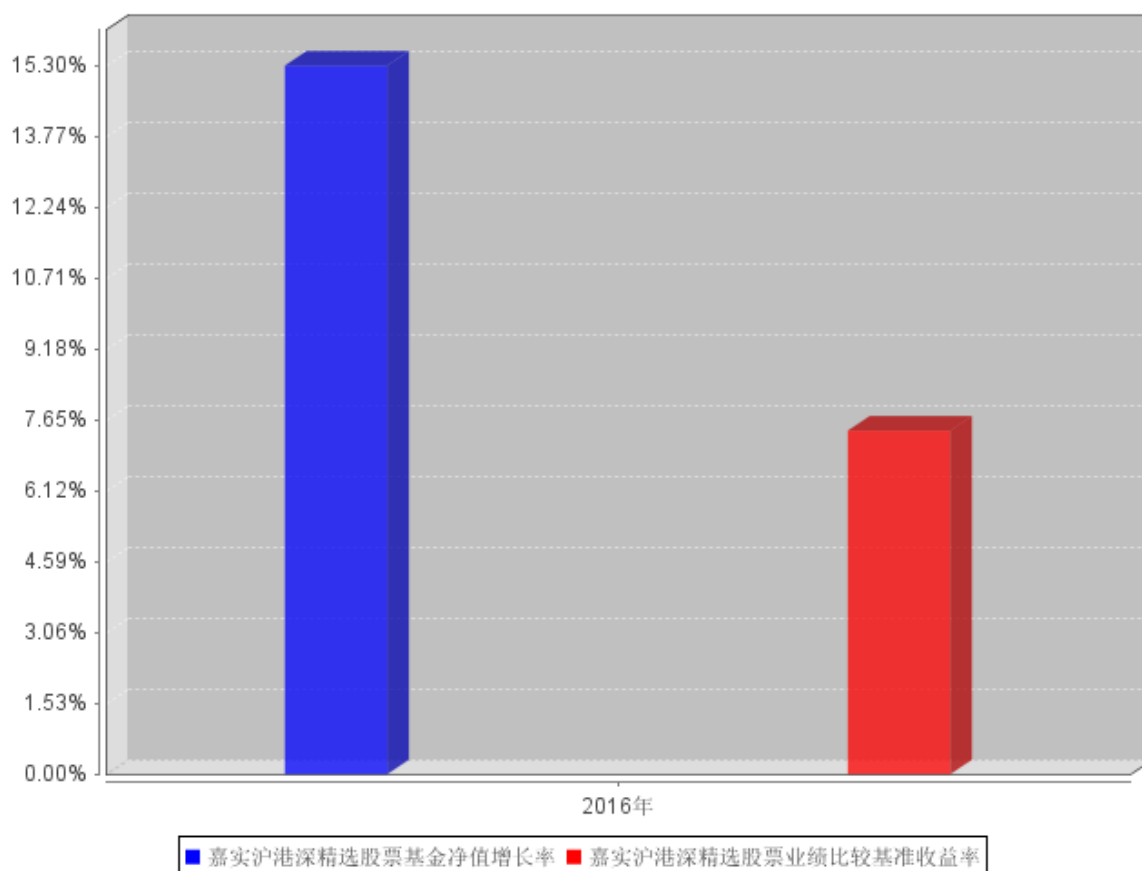
图：嘉实沪港深精选股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年5月27日至2016年12月31日)

注：本基金基金合同生效日2016年5月27日至报告期末未满1年。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（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

嘉实沪港深精选股票自基金合同生效以来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



注：本基金基金合同生效日为 2016 年 5 月 27 日，2016 年度的相关数据根据当年实际存续期（2016 年 5 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日）计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

## §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	证券从业	说明
----	----	----------------	------	----

		限		年限	
		任职日期	离任日期		
张金涛	本基金、嘉实稳盛债券基金经理	2016年5月27日	-	12年	曾任中金公司研究部能源组组长。润晖投资高级副总裁，负责能源和原材料等行业的研究和投资。2012年10月加入嘉实基金，现任海外研究组组长，负责海外投资策略以及能源原材料行业研究。

注：（1）基金经理任职日期是指本基金基金合同生效之日；（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、《嘉实沪港深精选股票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间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

本基金成立于 2016 年 5 月 27 日，此时上证综合指数处于 2800 多点的相对低位，恒生指数则在 20600 点附近震荡。通过对市场及个股风险回报的分析判断，我们在 7 月初英国脱欧公投落地以后迅速将股票仓位提高到 80% 以上，并且大部分仓位配置在港股。此后港股在三季度走出独立行情，基金净值得到较快增长。到 9 月底，恒生指数涨到 24000 点，港股市场整体估值已经趋于合理，而 A 股市场经历了一轮调整后风险收益比有所提升。此时，我们降低了港股配置，增加了 A 股的配置，加上所选股票的表现较好，基金净值并没有跟随港股市场下跌，反而持续上涨并在十一月下旬创出年内高点。此后由于特朗普当选美国总统，短期内市场风格变化剧烈，中上游周期股和金融股反弹，科技和成长股下跌，基金净值出现了明显回撤。至 12 月中下旬，我们主动增加了调整幅度较大的港股配置，降低了 A 股的持仓，为 2017 年以来至今的收益表现奠定了良好的基础。

投资策略上，我们以价值投资为主，优先选择低估值伴有基本面边际改善的股票，以期享受盈利和估值的双升，在股价上涨获利空间降低后及时获利了结。在深入研究的支持下，致力于挖掘领先市场的投资机会。鉴于港股市场流动性较差，交易成本较高，在买入港股股票时特别注意回避有治理问题的公司。在买入流动性较差的中小盘港股时，仓位要同时兼顾风险收益比和流动

性指标。

行业选择上，我们相信未来很长一段时间，中国都处于经济转型期，因此产业升级和消费升级是长期发展方向，能够主动进行产业升级、符合消费升级方向的公司值得长期关注。报告期内，基金大幅超配了汽车和电子这两个行业，获得一定的超额回报。对于周期股，我们的投资也是基于深入研究的基础上进行投资，对于持续性存疑的周期反弹保持谨慎。

#### 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 1.153 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.30%，业绩比较基准收益率为 7.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

##### A 股市场展望

A 股市场经历了 2015 到 2016 年的大起大落后，展望 2017 年，盈利仍能维持正增长，但增速可能会见顶回落。股票市场资金方面，金融去杠杆大背景下，股票市场也不是受杠杆抽离冲击最快，压力最大的资产，股市资金面有望因相对吸引力的提升面临改善。因此，从股票市场自身的总体盈利和流动性趋势而言，两者都有经历过往两年的超高双向波动后向一个比较温和的平稳趋势过度的可能。两大因素相互抵消下市场处于平衡市状态，全年上证指数涨跌幅可能会在个位数范围。但全年的市场过程可能仍将十分曲折，主要的风险在于货币政策阶段性收紧过度（通胀、汇率、房价等因素牵制），以及金融去杠杆的加速推进造成金融体系整体的流动性收紧。外部主要的风险在于地缘政治风险。

结构上看，2017 年的 A 股市场相比 2015 和 2016 年也是一个更难寻找清晰机会的市场——低估值价值股和强周期类股票经历了一整年的估值修复和业绩上升，但考虑到逐渐见顶的盈利增速和告别底部的市盈率，要靠景气度大幅超预期来继续提升估值的机会不大。另一方面，小市值成长股系统性的估值消化尽管 2016 年已经有了较大进展，但其外延并购业绩在 2017 年以后存在较大不确定性，且当前估值在一个流动性偏于收紧的市场预计尚未告别继续去化泡沫的阶段，预计仍在至少上半年的时间内徘徊在消化估值泡沫的路途上。全年收益率而言，我们认为大市值风格仍将整体胜出、但优势会比 2016 年要弱，应当深入行业和个股仔细分辨相对收益的机会。

##### 港股市场展望

港股市场在 2016 年四季度经历了比较充分的调整，到 2016 年底整体估值重新具有了吸引力，加上盈利有望持续增长，这使得我们对 2017 年港股市场比较乐观。我们预期恒生指数将在 2017 年继续获得正回报，并且有很大机会跑赢 A 股。这是因为港股估值水平仍较 A 股便宜，国

内资金对海外资产配置的热情不减，而在其他渠道不畅通的情况下，资金仍会通过港股通南下，从而逐渐抬升港股的估值水平和交易活跃度。此外在经历了特朗普交易影响之后，国际资金也有望回流香港市场，进一步推动港股的行情。我们相对看好上半年，特别是一季度的港股机会。在二季度以后，中国经济增速可能会逐步回落，而通胀仍处于相对较高的位置，加上美元继续加息的压力持续存在，股指可能会有一定的调整压力。

我们将继续以价值投资为主要策略，深入研究行业发展趋势，挖掘结构性的投资机会。行业选择上，我们将继续关注产业升级和消费升级这两个长期方向，同时加大对深度价值的周期性投资机会的研究。在 2017 年相对看好港股电子、医药、博彩、保险、农业和原材料等行业的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 报告期内本基金未实施利润分配；

(2) 根据本报告 3.1.1 “本期利润”为-13,339,335.58 元，以及本基金基金合同（十六（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，报告期内本基金未实施利润分配，符合基金合同的约定。

#### 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”）在嘉实沪港深精选股票型证券投资基金（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

嘉实沪港深精选股票型证券投资基金 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 20692 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：嘉实沪港深精选股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	227,954,192.09
结算备付金		11,883,558.08
存出保证金		254,619.68
交易性金融资产	7.4.7.2	1,236,359,762.19
其中：股票投资		1,236,359,762.19
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		4,625,336.05
应收利息	7.4.7.5	38,588.77
应收股利		244,943.47
应收申购款		710,498.56
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,482,071,498.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
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		2,543,488.95
应付赎回款		105,565,963.20
应付管理人报酬		1,883,355.23
应付托管费		313,892.55
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	1,099,542.01
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	243,375.90
负债合计		111,649,617.84
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,188,751,926.24
未分配利润	7.4.7.10	181,669,954.81
所有者权益合计		1,370,421,881.05

负债和所有者权益总计		1,482,071,498.89
------------	--	------------------

注：本基金合同生效日为 2016 年 5 月 27 日，本报告期自基金合同生效日 2016 年 5 月 27 日起至 2016 年 12 月 31 日止。报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.153 元，基金份额总额 1,188,751,926.24 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实沪港深精选股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 5 月 27 日(基金合同 生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-4,562,198.49
1. 利息收入		979,970.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	595,722.97
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		384,247.17
其他利息收入		-
2. 投资收益		6,099,023.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,302,987.83
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	796,035.62
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	-13,557,806.28
4. 汇兑收益		-
5. 其他收入	7.4.7.17	1,916,614.20
<b>减：二、费用</b>		8,777,137.09
1. 管理人报酬		4,839,687.04
2. 托管费		806,614.48
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	2,997,431.70
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	133,403.87
<b>三、利润总额</b>		-13,339,335.58
减：所得税费用		-

<b>四、净利润</b>		-13,339,335.58
--------------	--	----------------

注：本基金合同生效日为 2016 年 5 月 27 日，本期是指 2016 年 5 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日，无上年度可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实沪港深精选股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)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）	231,073,100.91	-	231,073,100.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,339,335.58	-13,339,335.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	957,678,825.33	195,009,290.39	1,152,688,115.72
其中：1. 基金申购款	1,353,852,308.08	240,196,603.42	1,594,048,911.50
2. 基金赎回款	-396,173,482.75	-45,187,313.03	-441,360,795.78
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）	1,188,751,926.24	181,669,954.81	1,370,421,881.05

注：本基金合同生效日为 2016 年 5 月 27 日，本期是指 2016 年 5 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日，无上年度可比期间数据。

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

### 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

本期(2016年5月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

#### 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5月27日(基金合同生效日)至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,839,687.04
其中:支付销售机构的客户维护费	501,618.28

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1.5%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×1.5% / 当年天数。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年5月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日
----	---------------------------------------



当期发生的基金应支付的托管费	806,614.48
----------------	------------

注：支付基金托管人中国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（2016 年 5 月 27 日（基金合同生效日）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（2016 年 5 月 27 日（基金合同生效日）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（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 2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	227,954,192.09	379,370.89

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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（2016 年 5 月 27 日（基金合同生效日）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（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

###### 7.4.5.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	网下申购

603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	未上市	23.16	23.16	3,283	76,034.28	76,034.28	网下申购
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	未上市	21.30	21.30	3,052	65,007.60	65,007.60	网下申购
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	未上市	40.29	40.29	1,489	59,991.81	59,991.81	网下申购
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	未上市	7.87	7.87	4,481	35,265.47	35,265.47	网下申购
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	网下申购
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	未上市	14.11	14.11	1,338	18,879.18	18,879.18	网下申购
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	未上市	6.55	6.55	1,693	11,089.15	11,089.15	网下申购
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	未上市	15.28	15.28	659	10,069.52	10,069.52	网下申购
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	未上市	3.07	3.07	2,269	6,965.83	6,965.83	网下申购
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	未上市	4.94	4.94	1,366	6,748.04	6,748.04	网下申购

#### 7.4.5.1.2 受限证券类别：债券

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债券。

#### 7.4.5.1.3 受限证券类别：其他

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其他证券。

#### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末（2016年12月31日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.5.3 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	1,236,359,762.19	83.42
	其中：股票	1,236,359,762.19	83.42
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	239,837,750.17	16.18
7	其他各项资产	5,873,986.53	0.40
8	合计	1,482,071,498.89	100.00

注：通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 750,194,876.00 元，占基金资产净值的比例为 54.74%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 87,582,240.00 元，占基金资产净值的比例为 6.39%。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	341,378,956.93	24.91

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,265.47	0.00
E	建筑业	40,436,000.00	2.95
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,920,643.79	0.29
J	金融业	106,780.00	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	12,705,000.00	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	398,582,646.19	29.08

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	105,969,540.00	7.73
必需消费品	32,501,030.00	2.37
金融	104,870,000.00	7.65
医疗保健	61,223,580.00	4.47
工业	17,876,700.00	1.30
信息技术	339,838,926.00	24.80
原材料	34,108,000.00	2.49
房地产	2,640,000.00	0.19
电信服务	63,672,000.00	4.65
公用事业	75,077,340.00	5.48
合计	837,777,116.00	61.13

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	H02382	舜宇光学科技	3,257,000	98,915,090.00	7.22
2	601058	赛轮金宇	17,000,000	69,190,000.00	5.05
3	H00354	中国软件国际	20,000,000	65,200,000.00	4.76
4	H00941	中国移动	800,000	58,824,000.00	4.29
5	H00371	北控水务集团	12,636,000	58,378,320.00	4.26
6	300433	蓝思科技	2,098,293	57,933,869.73	4.23
7	H00700	腾讯控股	321,400	54,538,366.00	3.98
8	H02628	中国人寿	3,000,000	54,210,000.00	3.96
9	002475	立讯精密	2,579,802	53,530,891.50	3.91
10	H00027	银河娱乐	1,398,000	42,261,540.00	3.08

注：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 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	H02382	舜宇光学科技	112,251,810.84	8.19
2	601058	赛轮金宇	72,350,766.59	5.28
3	H00354	中国软件国际	69,280,047.05	5.06
4	H00941	中国移动	66,427,595.27	4.85
5	H00371	北控水务集团	62,031,012.64	4.53
6	H02628	中国人寿	57,340,334.62	4.18
7	H00700	腾讯控股	56,505,609.58	4.12
8	300433	蓝思科技	55,027,262.36	4.02
9	002475	立讯精密	54,078,820.76	3.95
10	002106	莱宝高科	47,942,177.77	3.50
11	H00175	吉利汽车	45,294,252.25	3.31
12	002008	大族激光	44,748,339.51	3.27
13	600068	葛洲坝	40,936,249.79	2.99
14	H00027	银河娱乐	38,054,933.58	2.78

15	300097	智云股份	36,776,391.63	2.68
16	H01928	金沙中国有限公司	36,325,355.89	2.65
17	000786	北新建材	33,896,481.42	2.47
18	H00606	中国粮油控股	32,438,011.61	2.37
19	H00732	信利国际	31,935,338.83	2.33
20	H00285	比亚迪电子	30,044,330.16	2.19
21	H00966	中国太平	29,274,977.01	2.14
22	002439	启明星辰	28,265,277.02	2.06

#### 8.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	H00175	吉利汽车	52,265,850.60	3.81
2	002008	大族激光	43,323,416.25	3.16
3	002106	莱宝高科	41,773,085.09	3.05
4	300097	智云股份	32,856,184.90	2.40
5	002439	启明星辰	21,613,846.09	1.58
6	000498	山东路桥	13,400,597.69	0.98
7	002236	大华股份	13,273,969.92	0.97
8	000333	美的集团	9,608,737.30	0.70
9	H02238	广汽集团	9,593,740.71	0.70
10	002434	万里扬	9,544,535.32	0.70
11	600350	山东高速	9,009,678.75	0.66
12	000969	安泰科技	7,891,896.00	0.58
13	600201	生物股份	7,174,356.94	0.52
14	H00941	中国移动	7,111,117.87	0.52
15	600258	首旅酒店	6,707,511.98	0.49
16	002502	骅威文化	5,565,769.57	0.41
17	600887	伊利股份	5,468,229.01	0.40
18	600872	中炬高新	4,841,988.97	0.35
19	H06886	HTSC	4,824,730.94	0.35
20	600660	福耀玻璃	4,779,621.72	0.35

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,626,315,628.53
卖出股票收入（成交）总额	381,701,047.89

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”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。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

## 8.6 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。

## 8.7 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。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

## 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权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	254,619.68

2	应收证券清算款	4,625,336.05
3	应收股利	244,943.47
4	应收利息	38,588.77
5	应收申购款	710,498.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,873,986.53

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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
11,704	101,568.00	968,982,766.77	81.51%	219,769,159.47	18.49%

### 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	1,336,563.71	0.11%

### 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	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（2016年5月27日）基金份额总额	231,073,100.91
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,353,852,308.08
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	396,173,482.75
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,188,751,926.24

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## §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。

#### (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

本基金基金合同生效日为2016年5月27日，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50,000.00元，该审计机构第1年提供审计服务。

## 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

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券股份有限公司	1	11,218,916,914.01	60.75%	853,242.32	60.75%	新增
国泰君安证券股份有限公司	2	787,488,753.50	39.25%	551,248.45	39.25%	新增
中国中投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	新增
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	新增
中泰证券股份有限公司	4	-	-	-	-	新增
安信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	新增
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
东方证券股份有限公司	4	-	-	-	-	新增
东吴证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
方正证券股份有限公司	3	-	-	-	-	新增
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
广发证券股份有限公司	5	-	-	-	-	新增
广州证券股份	2	-	-	-	-	新增

有限公司						
国金证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	新增
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
海通证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	新增
宏信证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	新增
申万宏源西部 证券有限公司	1	-	-	-	-	新增
华宝证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	新增
华创证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	新增
民生证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	新增
中国民族证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
平安证券有限 责任公司	4	-	-	-	-	新增
申万宏源集团 股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	新增
新时代证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	新增
信达证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
兴业证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	新增
中国银河证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
长城证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	新增
长江证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	新增
浙商证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	新增

中国国际金融 股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
中信建投证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
中银国际证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	新增

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。

注 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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券回购交易	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	1,210,400,000.00	100.00%

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