

# 嘉实沪深 300 指数研究增强型证券投资基金 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

### 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。

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	嘉实沪深 300 指数研究增强型证券投资基金
基金简称	嘉实沪深 300 指数研究增强
基金主代码	000176
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 26 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	302,651,579.36 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，力求对标的指数（沪深 300 指数）进行有效跟踪的基础上，通过精选个股策略增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金以谋求基金资产的长期增值为目标，主要采用指数增强的投资策略，以沪深 300 作为基金投资组合的标的指数，结合深入的基本面研究及指数化管理的基础上优化投资组合，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，本基金属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 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

### 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	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
--------------------	---

址	
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 12 月 26 日 (基金合同生效日)– 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-17,915,510.13	189,690,055.73	-4,125.41
本期利润	-19,456,763.00	186,931,580.12	2,623,602.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0617	0.3270	0.0019
本期加权平均净值利润率	-6.09%	29.55%	0.19%
本期基金份额净值增长率	-7.42%	13.23%	0.19%
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	15,216,570.01	38,092,345.25	-4,125.41
期末可供分配基金份额利润	0.0503	0.1345	0.0000
期末基金资产净值	317,868,149.37	321,365,523.34	1,364,308,414.31
期末基金份额净值	1.0503	1.1345	1.0019
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	5.03%	13.45%	0.19%

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。

#### 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	0.11%	0.61%	1.67%	0.67%	-1.56%	-0.06%
过去六个月	4.59%	0.68%	4.72%	0.72%	-0.13%	-0.04%
过去一年	-7.42%	1.37%	-10.63%	1.33%	3.21%	0.04%
自基金合同	5.03%	1.90%	-0.20%	1.91%	5.23%	-0.01%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

沪深300指数是由中证指数有限公司编制，它的样本选自沪深两个证券市场300只股票，具备市场覆盖度广、代表性强、流动性强、指数编制方法透明等特点。它能够反映中国A股市场整体状况和发展趋势。

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：

Benchmark(0)=1000

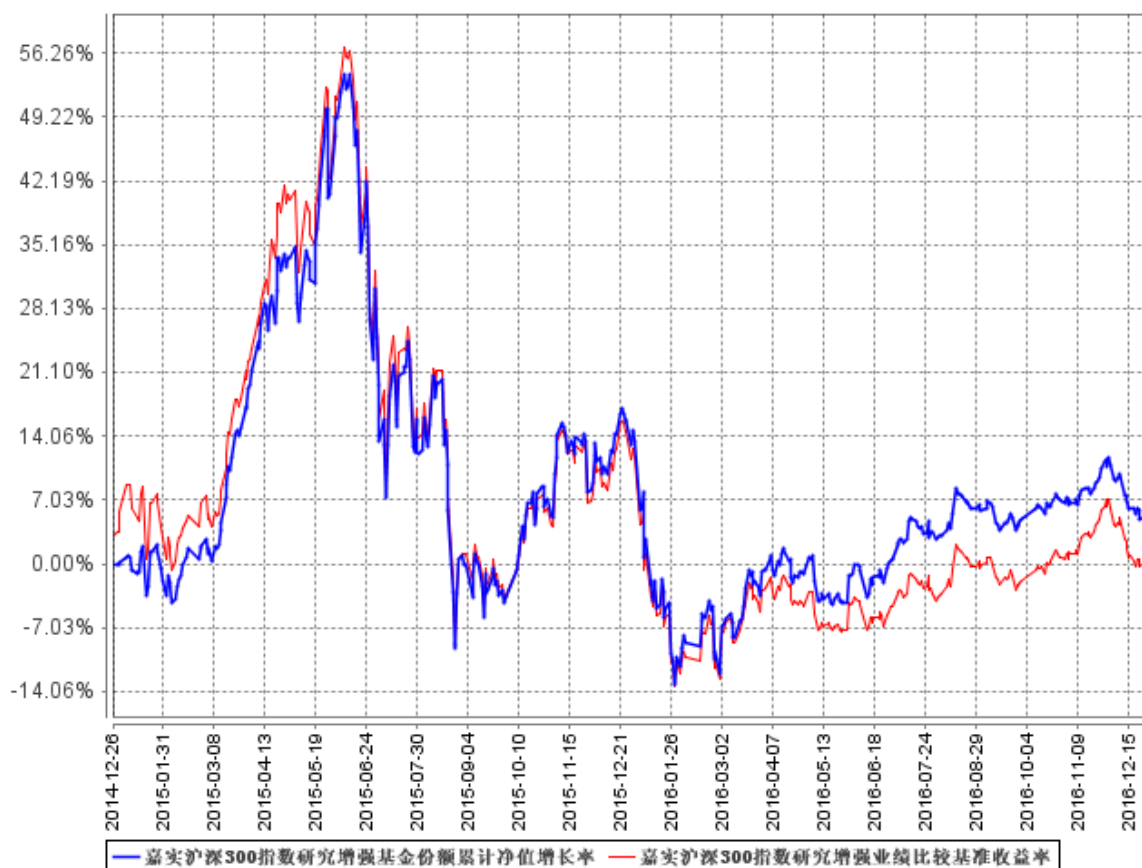
Return(t)=95%×(沪深300指数(t)/沪深300指数(t-1)-1)+5%×银行活期存款利率（税后）

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中 t=1, 2, 3, …。

### 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

#### 嘉实沪深300指数研究增强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：嘉实沪深300指数研究增强型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

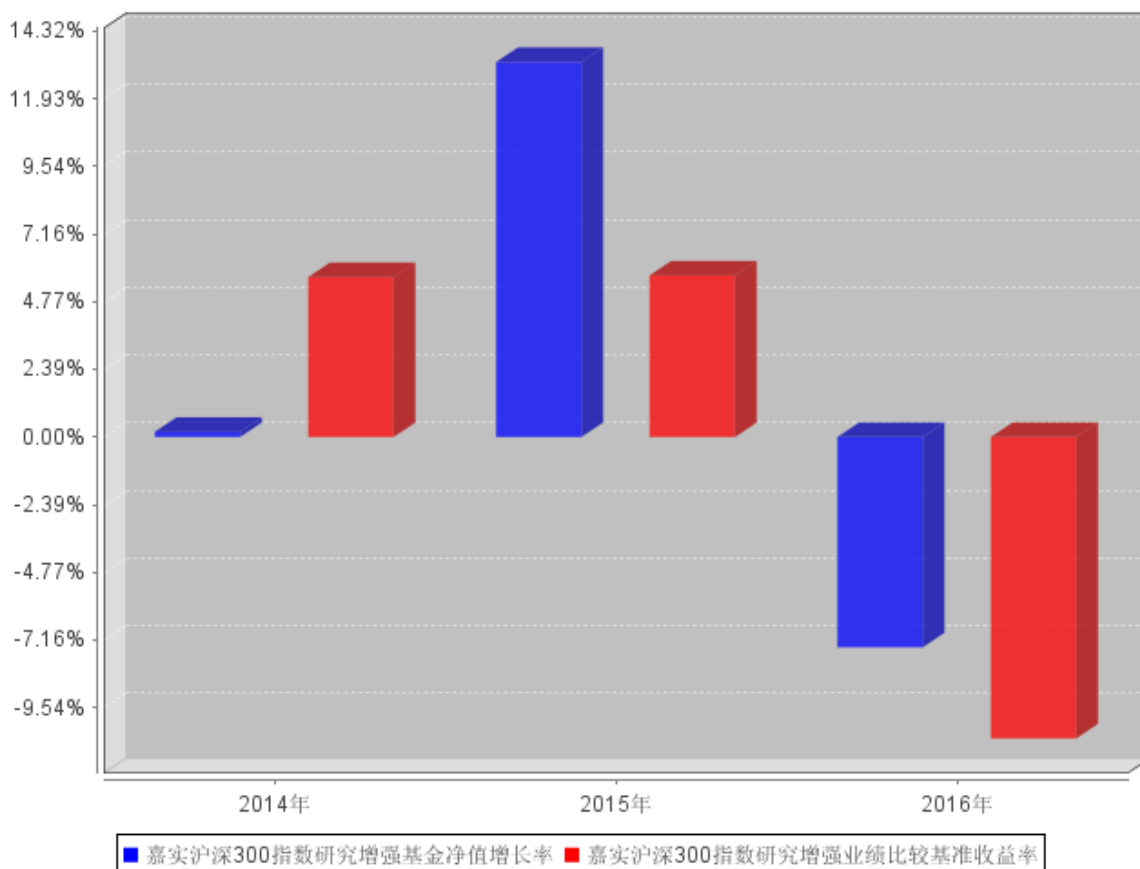
(2014 年 12 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日)

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(十二(二)投资范围和(四)投资限制)的有关约定。

注 2: 2016 年 7 月 23 日, 本基金管理人发布《关于嘉实沪深 300 指数研究增强基金经理变更的公告》, 张琦女士不再担任本基金基金经理职务, 聘请李欣先生担任本基金基金经理职务。

### 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

嘉实沪深300指数研究增强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 2014 年 12 月 26 日, 2014 年度的相关数据根据当年实际存续期(2014 年 12 月 26 日至 2014 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）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李欣	本基金基金经理	2016 年 7 月 23 日	-	5 年	硕士研究生。曾任普华永道高级精算师、中国国际金融有限公司研究员、海通证券股份有限公司高级分析师。2014 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司研究部，任研究员一职。具有基金从业资格，中国国籍。
张琦	本基金、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实研究阿尔法股票、嘉实对冲套利定期混合基金经理，公司研究部副总监	2014 年 12 月 26 日	2016 年 7 月 23 日	10 年	硕士研究生。2005 年 7 月加入嘉实基金，历任行业研究员、金融地产研究组组长，2011 年 3 月至今担任研究部副总监。具有基金从业资格，中国国籍。

注：（1）基金经理张琦的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理李欣的任职日期是指公司作出决定后公告之日，离任日期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、《嘉实沪深 300 指数研究增强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

回顾 2016 年，A 股市场整体呈现低波动状态，在年初系统性风险释放后，指数窄幅震荡，个股剧烈分化。前期，主要源于对人民币的贬值预期以及熔断机制的情绪放大作用，市场参与者的风险偏好明显下降，短期跌幅较大，市场风险急剧释放。随后，市场逐渐进入存量博弈的反弹行情，指数呈现窄幅震荡的状态，但不同股票间分化逐渐扩大。从全年看，市场流动性依旧宽松，对部分小市值股票的估值仍有维持和提升作用，同时，在补库存周期及供给侧改革的驱动下，煤炭、钢铁及有色等周期性行业受益于资源价格的上涨，企业利润有显著改善，相关行业表现较好。微观层面看，市场投资者结构的变化也带来了显著影响，追求绝对收益的机构投资者占比的上升（如银行委外和保险资金），使得市场博弈加剧，也带来市场有效性的提升。行业和风格方面，低 PE 和低 PB 相关行业涨幅较大，同时估值偏高板块仍处于估值消化过程中，特别是新兴产业。食品饮料、家电、银行、煤炭和石化等行业涨幅居前，而传媒、计算机、餐饮旅游、交通运输和国防军工等行业跌幅相对较大。

本基金在严格控制组合跟踪误差、组合偏离度的基础上，利用嘉实基本面研究成果和自下而上个股精选策略，在控制指数跟踪误差的同时增强基金阿尔法收益，力争超越标的指数收益率。

### 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 1.0503 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.42%，业绩比较基准收益率为-10.63%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场表现为各类波动率维持在较低水平，无论是个股波动、行业波动还是风格波动。低波动的市场环境提高了获取超额收益难度。我们预期这种状态大概率会得到延续。另一方面，尽管短期宏观经济数据有所好转，利好部分低估值和周期类行业股票，但考虑到当前金融市场的高杠杆特征，市场流动性在边际上难以进一步宽松，甚至会呈现出去杠杆下的偏紧状态，对市场整体形成偏负面的影响，而 IPO 延续当前的发行速度也将对高估值股票的估值水平形成一定冲击和压力。展望未来，市场投资者的情绪仍大概率维持偏谨慎状态，同时，高估值类股票的估值压力较大，股票走向更多取决于业绩是否能够持续超预期。在投资策略层面上，仍将以轻指数，重选股为核心，进一步提高个股选择标准，提升选股确定性和准确度。

在更为复杂的市场环境下，我们将继续在行业中性的框架内坚持自下而上精选个股的投资策略，更精细和严格控制风险，以降低最大回撤和净值波动幅度，在控制指数跟踪误差的同时力争

为持有人创造更多的超额收益。

#### 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-19,456,763.00 元，以及本基金基金合同（十六

(三) 基金收益分配原则）的约定，报告期内本基金未实施利润分配，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，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

嘉实沪深 300 指数研究增强型证券投资基金 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 20691 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：嘉实沪深 300 指数研究增强型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	28,571,759.50	20,745,556.35
结算备付金		176,112.25	442,632.59
存出保证金		17,038.51	121,025.05
交易性金融资产	7.4.7.2	289,998,753.36	300,897,319.39
其中：股票投资		289,998,753.36	300,897,319.39
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		-	246,194.63
应收利息	7.4.7.5	6,221.65	4,981.13
应收股利		-	-
应收申购款		233,152.56	666,604.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		319,003,037.83	323,124,313.92
<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>上年度末 2015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		-	-
应付赎回款		277,710.29	825,474.40
应付管理人报酬		273,469.04	279,846.41
应付托管费		49,224.44	50,372.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	113,731.41	161,038.89
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	420,753.28	442,058.52
负债合计		1,134,888.46	1,758,790.58
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	302,651,579.36	283,273,178.09
未分配利润	7.4.7.10	15,216,570.01	38,092,345.25
所有者权益合计		317,868,149.37	321,365,523.34
负债和所有者权益总计		319,003,037.83	323,124,313.92

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0503 元，基金份额总额 302,651,579.36 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实沪深 300 指数研究增强型证券投资基金

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		-14,228,638.86	201,501,742.99
1.利息收入		181,262.07	858,481.49
其中：存款利息收入	7.4.7.11	181,262.07	736,927.28
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		-	121,554.21
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-13,643,891.18	192,494,215.59
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-19,792,287.04	185,579,105.27
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	6,148,395.86	6,915,110.32
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	-1,541,252.87	-2,758,475.61
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	775,243.12	10,907,521.52
<b>减：二、费用</b>		5,228,124.14	14,570,162.87
1.管理人报酬		3,195,781.44	6,435,462.54
2.托管费		575,240.61	1,158,383.35
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	863,965.54	6,357,333.62
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	593,136.55	618,983.36
<b>三、利润总额</b>		-19,456,763.00	186,931,580.12
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		-19,456,763.00	186,931,580.12

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实沪深 300 指数研究增强型证券投资基金

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)	283,273,178.09	38,092,345.25	321,365,523.34
二、本期经营活动产生	-	-19,456,763.00	-19,456,763.00

的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	19,378,401.27	-3,419,012.24	15,959,389.03
其中：1.基金申购款	209,127,173.48	-2,870,800.45	206,256,373.03
2.基金赎回款	-189,748,772.21	-548,211.79	-190,296,984.00
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）	302,651,579.36	15,216,570.01	317,868,149.37
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）	1,361,684,811.94	2,623,602.37	1,364,308,414.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	186,931,580.12	186,931,580.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,078,411,633.85	-151,462,837.24	-1,229,874,471.09
其中：1.基金申购款	898,943,017.28	221,839,324.21	1,120,782,341.49
2.基金赎回款	-1,977,354,651.13	-373,302,161.45	-2,350,656,812.58
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）	283,273,178.09	38,092,345.25	321,365,523.34

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                      \_\_\_\_\_ 王红                      \_\_\_\_\_ 常旭  
 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
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 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。

#### 7.4.4.2 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	3,195,781.44	6,435,462.54
其中：支付销售机构的客户维护费	929,001.03	3,198,921.41

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% 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% / 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 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托管费	575,240.61	1,158,383.35

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 0.18% 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×0.18% / 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

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
	中国建设银行	28,571,759.50	174,086.13	20,745,556.35

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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 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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----



600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事 项停牌	14.60	-	-	243,400	4,673,213.88	3,553,640.00	-
300104	乐视网	2016 年 12 月 7 日	重大事 项停牌	32.96	2017 年 1 月 16 日	36.88	99,740	4,975,095.99	3,287,430.40	-
600406	国电南瑞	2016 年 12 月 28 日	重大事 项停牌	16.63	-	-	117,700	1,722,070.20	1,957,351.00	-
000540	中天城投	2016 年 11 月 28 日	重大事 项停牌	6.93	2017 年 1 月 3 日	7.00	242,500	1,614,526.66	1,680,525.00	-
002462	嘉事堂	2016 年 9 月 28 日	重大事 项停牌	43.68	2017 年 1 月 12 日	38.98	14,500	567,273.00	633,360.00	-
002400	省广股份	2016 年 11 月 28 日	重大事 项停牌	13.79	-	-	40,358	602,536.06	556,536.82	-
002440	闰土股份	2016 年 10 月 21 日	重大事 项停牌	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	15,700	265,458.27	256,538.00	-
300047	天源迪科	2016 年 8 月 15 日	重大事 项停牌	18.36	2017 年 1 月 6 日	19.00	13,400	225,700.18	246,024.00	-
300271	华宇软件	2016 年 12 月 19 日	重大事 项停牌	17.45	-	-	12,487	226,739.00	217,898.15	-
603308	应流股份	2016 年 11 月 24 日	重大事 项停牌	21.92	2017 年 2 月 14 日	21.92	8,500	179,690.00	186,320.00	-

### 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	289,998,753.36	90.91
	其中：股票	289,998,753.36	90.91
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	28,747,871.75	9.01
7	其他各项资产	256,412.72	0.08
8	合计	319,003,037.83	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	275,860.00	0.09
B	采矿业	5,848,016.38	1.84
C	制造业	72,148,352.78	22.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,477,316.00	1.72
E	建筑业	8,134,918.10	2.56
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,768,783.50	2.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,415,065.24	3.59
J	金融业	95,480,125.05	30.04
K	房地产业	19,667,800.74	6.19

L	租赁和商务服务业	2,607,804.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,439,239.52	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,411,280.00	0.44
R	文化、体育和娱乐业	3,479,436.00	1.09
S	综合	295,924.00	0.09
	合计	236,449,921.31	74.39

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	734,589.00	0.23
C	制造业	42,308,645.07	13.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	461,240.00	0.15
E	建筑业	463,993.51	0.15
F	批发和零售业	1,360,964.00	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	1,577,784.55	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,253,190.82	0.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,572,916.00	0.49
L	租赁和商务服务业	556,536.82	0.18
M	科学研究和技术服务业	654,885.00	0.21
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	557,114.28	0.18
Q	卫生和社会工作	408,916.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	1,638,057.00	0.52

S	综合	-	-
	合计	53,548,832.05	16.85

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 8.3.1 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	601318	中国平安	326,934	11,583,271.62	3.64
2	000001	平安银行	1,269,805	11,555,225.50	3.64
3	601169	北京银行	1,171,264	11,431,536.64	3.60
4	600036	招商银行	579,319	10,196,014.40	3.21
5	601166	兴业银行	576,466	9,304,161.24	2.93
6	600340	华夏幸福	373,880	8,935,732.00	2.81
7	601688	华泰证券	432,000	7,715,520.00	2.43
8	600016	民生银行	761,200	6,911,696.00	2.17
9	600109	国金证券	479,727	6,250,842.81	1.97
10	600376	首开股份	519,100	6,130,571.00	1.93

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。

#### 8.3.2 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	000488	晨鸣纸业	1,162,300	12,041,428.00	3.79
2	002078	太阳纸业	701,300	4,684,684.00	1.47
3	603899	晨光文具	93,000	1,692,600.00	0.53
4	002035	华帝股份	63,400	1,645,230.00	0.52
5	600325	华发股份	76,400	977,920.00	0.31

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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601688	华泰证券	11,013,620.46	3.43
2	601169	北京银行	10,135,066.40	3.15
3	600376	首开股份	8,676,146.29	2.70
4	600340	华夏幸福	7,810,362.15	2.43
5	000783	长江证券	7,192,825.39	2.24
6	601601	中国太保	6,846,766.95	2.13
7	600030	中信证券	6,790,595.00	2.11
8	600900	长江电力	6,159,636.50	1.92
9	000488	晨鸣纸业	6,003,294.27	1.87
10	600016	民生银行	5,740,338.31	1.79
11	600109	国金证券	5,516,303.00	1.72
12	002078	太阳纸业	5,482,893.08	1.71
13	000712	锦龙股份	5,247,887.06	1.63
14	000402	金融街	4,698,898.06	1.46
15	000651	格力电器	4,640,372.50	1.44
16	600066	宇通客车	4,624,980.00	1.44
17	601318	中国平安	4,416,086.64	1.37
18	000333	美的集团	4,399,088.41	1.37
19	600816	安信信托	4,386,853.29	1.37
20	600048	保利地产	4,103,602.60	1.28

### 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000783	长江证券	9,205,142.21	2.86
2	601398	工商银行	7,161,418.33	2.23
3	000333	美的集团	7,042,630.70	2.19
4	601688	华泰证券	6,523,319.79	2.03
5	600705	中航资本	5,418,996.32	1.69

6	000712	锦龙股份	5,387,899.00	1.68
7	601328	交通银行	5,330,847.63	1.66
8	601021	春秋航空	4,970,498.64	1.55
9	601601	中国太保	4,888,073.59	1.52
10	000402	金融街	4,701,743.00	1.46
11	601318	中国平安	4,497,583.00	1.40
12	601006	大秦铁路	4,409,267.00	1.37
13	600048	保利地产	4,043,906.00	1.26
14	601336	新华保险	3,910,945.63	1.22
15	000002	万科A	3,836,572.51	1.19
16	600547	山东黄金	3,747,172.36	1.17
17	600816	安信信托	3,461,363.47	1.08
18	000651	格力电器	3,454,956.89	1.08
19	300133	华策影视	3,411,455.52	1.06
20	600030	中信证券	3,293,971.00	1.02

### 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	342,461,914.02
卖出股票收入（成交）总额	332,026,940.14

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

(1) 根据 2016 年 11 月 29 日华泰证券《关于收到中国证监会〈行政处罚决定书〉的公告》，证监会决定对华泰证券责令改正，给予警告，没收违法所得 18,235,275.00 元，并处以 54,705,825.00 元罚款。

本基金投资于“华泰证券（601688）”的决策程序说明：基于对华泰证券基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“华泰证券”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他九名证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、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	17,038.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,221.65
5	应收申购款	233,152.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	256,412.72

### 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****8.12.5.1 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。

**8.12.5.2 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，本基金前五名积极投资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
10,069	30,057.76	776,965.11	0.26%	301,874,614.25	99.74%

**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	96,830.76	0.03%

**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	0~10
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（2014年12月26日）基金份额总额	1,361,684,811.94
本报告期期初基金份额总额	283,273,178.09



本报告期基金总申购份额	209,127,173.48
减:本报告期基金总赎回份额	189,748,772.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	302,651,579.36

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。

2016 年 7 月 23 日,本基金管理人发布《关于嘉实沪深 300 指数研究增强基金经理变更的公告》,张琦女士不再担任本基金基金经理,聘请李欣先生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 70,000.00 元,该审计机构已连续 2 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	
中信建投证券股份有限公司	2	310,478,241.93	46.04%	217,336.58	46.04%	-
广发证券股份有限公司	1	120,948,318.55	17.93%	84,663.84	17.93%	-
招商证券股份有限公司	1	120,611,413.80	17.88%	84,429.47	17.88%	-
海通证券股份有限公司	1	79,977,313.73	11.86%	55,984.12	11.86%	-
申万宏源集团股份有限公司	2	42,413,976.25	6.29%	29,689.80	6.29%	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券有限公司	1	-	-	-	-	-

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。”

注 3: 宏源证券股份有限公司更名为申万宏源西部证券有限公司。

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