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%

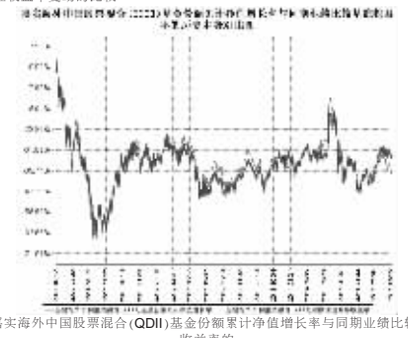
注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；(3)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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%
过去六个月	12.14%	0.92%	5.30%	0.96%	6.84%	- 0.04%
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

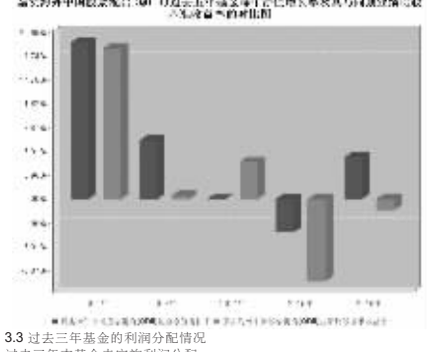


图：嘉实海外中国股票混合(QDII)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的
历史走势对比图
（2007 年 10 月 12 日至 2016 年 12 月 31 日）

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



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 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		
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，2013 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遵规守信情况的说明

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局域性信用事件风险。

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历。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 管理人对报告期内本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、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 630, 669, 667.60	229, 714, 353.15	- 400, 955, 314.45
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：

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