

嘉实沪港深精选股票型证券投资基金

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确认，并由董事长签发。

基金管理人中行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，报告复核人不存在虚假记载、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本基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金管理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。

本报告书摘要自2016年5月27日起至2016年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告全文，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
基金代码	000878
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
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严控风险控制，追求长期资产增值。
投资策略	本基金采用自下而上的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场环境、政策变化等因素进行定性和定量相结合的分析，确定大类资产（股票、债券、货币市场工具）的投资比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+恒生综合财富指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险和较高收益的证券投资基金，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。本基金将投资于港股通标的股票，需承担汇率风险以及海外市场风险。
基金管理人和基金托管人	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址	http://www.jrfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市建国门北大街8号京广中心大厦A座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

主要财务指标		基金净值表现		利润分配情况	
金额单位：人民币元					

3.1 本期数据和指标		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		-13,335,358.58	
本期利润		-1,370,421.88105		-2,027.5	
加权平均基金份额利润		1.153		-2.39%	
本期平均基金份额净值		15.30%			

3.1.2 本期数据和指标		2016年末		2016年	
期末可供分配利润		42,503,461.63		0.0358	
期末基金份额净值		1,370,421.88105		1,153	
期末基金份额总值		5,651,226.00		15.30%	
基金份额净值增长率		15.30%			

3.1.3 本期末数据和指标		2016年末		2016年	
基金份额净值增长率		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)扣除与支付给客户的费用后的余额,本期利润为本期已实现收益减去公允价值变动收益后扣除相关费用后的余额,本期利润与本期已实现收益之差即为本期的公允价值变动收益。(2)上述基金净值增长率不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,申购费用影响基金份额净值的计算,赎回费用影响基金份额净值的计算。(3)期末可供分配利润采用期末资产负责表中未分配利润和未利得的孰低数。(4)本基金合同生效日为2016年5月27日,报告期自2016年5月27日至2016年12月31日。					
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	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去一个月	1.68%	0.81%	-1.78%	0.64%	3.55%
过去二个月	14.73%	0.87%	5.00%	0.65%	9.73%
过去六个月	15.30%	0.80%	7.42%	0.72%	7.88%
过去一年					

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		2016年5月27日至2016年12月31日		2016年	
阶段	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去一个月	1.68%	0.81%	-1.78%	0.64%	3.55%
过去二个月	14.73%	0.87%	5.00%	0.65%	9.73%
过去六个月	15.30%	0.80%	7.42%	0.72%	7.88%
过去一年					

3.2.3 自基金合同生效以来每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较		2016年5月27日至2016年12月31日		2016年	
阶段	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去一个月	1.68%	0.81%	-1.78%	0.64%	3.55%
过去二个月	14.73%	0.87%	5.00%	0.65%	9.73%
过去六个月	15.30%	0.80%	7.42%	0.72%	7.88%
过去一年					

3.2.4 自基金合同生效以来每年净值增长率变动与同期业绩比较基准收益率变动的比较		2016年5月27日至2016年12月31日		2016年	
阶段	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去一个月	1.68%	0.81%	-1.78%	0.64%	3.55%
过去二个月	14.73%	0.87%	5.00%	0.65%	9.73%
过去六个月	15.30%	0.80%	7.42%	0.72%	7.88%
过去一年					

3.2.5 与同期业绩比较基准的偏离情况		2016年5月27日至2016年12月31日		2016年	
阶段	与同期业绩比较基准的偏离情况	偏离情况	偏离情况	①-③	②-④
过去一个月	1.68%	0.81%	-1.78%	0.64%	3.55%
过去二个月	14.73%	0.87%	5.00%	0.65%	9.73%
过去六个月	15.30%	0.80%	7.42%	0.72%	7.88%
过去一年					

3.2.6 与同期业绩比较基准的偏离情况		2016年5月27日至2016年12月31日		2016年	
阶段	与同期业绩比较基准的偏离情况	偏离情况	偏离情况	①-③	②-④
过去一个月	1.68%	0.81%	-1.78%	0.64%	3.55%
过去二个月	14.73%	0.87%	5.00%	0.65%	9.73%
过去六个月	15.30%	0.80%	7.42%	0.72%	7